



短期市場の推移

[億円] [%]				
	9月5日	9月8日	9月9日	9月10日
加重平均金利	0.477	0.477	0.477	0.477
東京レポレート(TN)	0.491	0.490	0.489	0.491
無コール残	87,342	87,252	86,791	85,009
ON	35,476	34,786	34,375	32,573
その他	51,866	52,466	52,416	52,436
有コール残	30,349	30,828	30,536	30,940

加重平均金利・コール残高は日銀、東京レポレートは日本証券業協会公表

※加重平均金利は無担保コールONのもの、無コール残は無担保・有担保コール残高の意。

本日の短期市場金利

[%]

	無担保コール(速報)			レポ市場
	最低	最高	平均	東京レポレート
O/N	0.450	0.525	0.480	0.489
T/N	-	-	-	0.489
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	-	0.482
2W	-	-	-	0.482
3W	-	-	-	0.481
1M	-	-	0.580	0.483
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	0.524
6M	-	-	-	0.571
1Y	-	-	-	0.673

無担保コール(速報)は日銀、東京レポレートは日本証券業協会公表

資金需給

[億円]

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	9月11日	9月12日	9月11日	9月12日	9月11日	9月12日
券	▲100		+300		+0	
財政	▲25,800		+9,000		▲7,000	
過不足	▲25,900		+9,300		▲7,000	
金融調節	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド	スタート
国債買入				+8,400		
社債等買入			▲400			
国債補充供給	+2,700	▲2,400	+2,400			
貸出増加支援			▲144,900	+10,700		
当座預金増減	▲25,600		▲114,500		▲7,000	
当座預金残高	5,109,500		4,995,000		4,988,000	
準備預金残高	4,674,000		主な需給要因			
積み終了先	4,674,000		源泉税揚げ 国債発行償還(個人) 国庫短期証券発行償還(3M) 流動性供給			
超過準備	4,674,000					
非準備先残高	435,500					
準備預金進捗率	100.0%					
平均	87.1%					
乖離率	12.9%					

国庫短期証券入札予定

9月12日	3ヶ月(第1331回)
9月17日	1年(第1332回)
9月18日	3ヶ月(第1333回)
9月26日	3ヶ月

国債入札予定

9月17日	20年
9月25日	40年
9月30日	2年
10月2日	10年

今月の国債買入オペ予定

オペ種類	一回当たりオファー金額	直近オファー額	オファー予定日					直近日	残り回数
1年以下	1000	1,000	3	11	24			9月3日	0
1年超3年以下	3250	3,250	3	11	24			9月11日	1
3年超5年以下	3250	3,250	3	24	29			9月3日	2
5年超10年以下	3500	3,500	11	24	29			9月11日	2
10年超25年以下	1350	1,350	3	11	24			9月11日	1
25年超	750	750	11	29				9月11日	1
物価連動債	500	500	29					8月27日	1
変動利付債	-	300						4月14日	-

9月12日の予定(時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
13:30	7月の鉱工業生産(確報)			-	
	-			-	
	-			-	

本日の市況

無担保コールON物は0.477%の出合から始まり、その後も同程度で推移した。一部金融機関による試し取りが行われたことから、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.003%の0.480%となった。

都銀・信託	証券	地銀
- ~ -	0.477 ~ 0.477	0.477 ~ 0.477

翌営業日のマーケット

試し取り要因剥落のため出合の水準は本日対比低下を予想する。

[%][億円] ※米ドル資金供給は百万\$

9月11日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
国債買入(9/12~)						
1~3年	3,250	9,892	3,253	0.001	0.005	26.7
5~10年	3,500	7,599	3,501	▲0.001	0.002	20.3
10~25年	1,350	3,980	1,354	▲0.002	0.000	40.6
25年~	750	2,183	751	▲0.008	▲0.003	84.1
国債補充供給(9/11~9/12)						
	2,162	2,162	0.250	0.250		
	360	360	0.250	0.250		

マネタリーベース [億円]

9月10日時点 6,351,300

所要

今積期の所要準備額	4,113,800
9月12日以降の残り所要	
積数	0
平均	0

本資料は投資環境等に関する情報提供を目的として作成したものです。本資料は投資勧誘を目的とするものではありません。有価証券等の取引には、リスクが伴います。投資についての最終決定は、投資家ご自身の判断と責任においてなされるようお願いいたします。当社は、いかなる投資の妥当性についても保証するものではありません。記載された意見や予測等は作成時点のものであり、正確性、完全性を保証するものではなく、今後予告なく変更されることがあります。

上田八木短資株式会社 登録金融機関 近畿財務局長(登金)第243号 加入協会 日本証券業協会