



短期市場の推移

[億円][%]

	9月2日	9月3日	9月4日	9月7日
加重平均金利	0.977	0.978	0.977	0.977
東京レボレート(TN)	1.000	1.000	1.000	1.000
無コール残	103,786	102,779	102,181	105,140
ON	40,119	38,502	38,234	40,943
その他	63,667	64,277	63,947	64,197
有コール残	23,860	23,455	23,221	24,091

加重平均金利・コール残高は日銀、東京レボ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。無有コール残は無担保・有担保コール残高の重。

本日の短期市場金利

[%]

	無担保コール(速報)			レボ市場
	最低	最高	平均	東京レボレート
O/N	0.950	0.978	0.977	1.000
T/N	-	-	1.025	1.000
S/N	-	-	1.025	-
1W	0.981	1.060	0.997	1.000
2W	-	-	-	1.000
3W	-	-	-	1.062
1M	1.260	1.270	1.268	1.126
2M	-	-	1.500	-
3M	-	-	-	1.234
6M	-	-	-	1.324
1Y	-	-	-	1.510

無担保コール(速報)は日銀、東京レボ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8日	9月9日	9月10日
券	+900	+600	+500
財政	▲11,000	▲33,600	+8,000
過不足	▲10,100	▲33,000	+8,500
金融調節	エンド	スタート	エンド
国債補完供給	+1,200	+500	スタート
当座預金増減	▲9,400	▲32,500	+8,500
当座預金残高	4,151,800	4,119,300	4,127,800
準備預金残高	3,835,800	主な需給要因	
積み終了先	3,835,800	国債発行(5年)	国庫短期証券発行償還(6M)
超過準備	3,835,800		
非準備先残高	316,000		
準備預金進捗率	99.9%		
平均	77.4%		
乖離率	22.5%		

国庫短期証券入札予定

9月9日	6ヶ月(第1405回)
9月11日	3ヶ月(第1406回)
9月16日	1年
9月17日	3ヶ月
国債入札予定	
9月15日	20年
9月29日	40年
9月30日	2年
10月6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	1,000	1,000	2	9月2日	0
1年超3年以下	3,550	3,550	9 28	8月19日	2
3年超5年以下	3,200	3,200	2 16	9月2日	1
5年超10年以下	3,350	3,350	9 16	8月19日	2
10年超25年以下	1,000	1,000	2 28	9月2日	1
25年超	750	750	9 16	8月19日	2
物価連動債	300	300	28	8月27日	1
変動利付債	-	300	-	4月14日	-

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

9月9日の予定(時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
	-			-	
	-			-	
	-			-	

本日の市況

無担保コールON物は0.977%の出合から始まり、その後も同程度で推移した。ON物加重平均金利(速報)は前営業対比横ばいの0.977%となった。

[%]

都銀・信託	証券	地銀
- ~ -	0.977 ~ 0.977	0.977 ~ 0.977

翌営業日のマーケット

出合いの水準は本日対比横ばい圏を予想する。

[%][億円]※米ドル資金供給は百万\$

9月8日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
国債補完供給(9/8~9/9)						
	489	489	0.500	0.500		
	0	0				
米ドル資金供給用担保国債供給(9/9~9/18)						
	5,000	9	9	0.970	0.970	
米ドル資金供給(9/10~9/17)						
	4	4	3.880			

マネタリーベース [億円]

9月7日時点 5,353,400

所要

[億円]

今積期の所要準備額	4,178,800
9月9日以降の残り所要	
積数	100
平均	0