



短期市場の推移

[億円] [%]

	9月3日	9月4日	9月7日	9月8日
加重平均金利	0.978	0.977	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	102,779	102,181	105,140	104,696
ON	38,502	38,234	40,943	39,729
その他	64,277	63,947	64,197	64,967
有コール残	23,455	23,221	24,091	23,239

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	1.030	0.977	1.000
T/N	-	-	-	1.000
S/N	-	-	-	-
1W	0.982	1.110	1.009	1.000
2W	-	-	1.060	1.001
3W	-	-	1.350	1.027
1M	-	-	-	1.138
2M	-	-	-	-
3M	1.410	1.420	1.417	1.243
6M	-	-	-	1.334
1Y	-	-	-	1.518

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9日	9月10日	9月10日	9月11日	9月11日	9月11日
券		+600		+100		+0
財政		▲35,900		+2,200		▲11,000
過不足		▲35,300		+2,300		▲11,000
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
国債補完供給	+500	▲400	+400			
国債買入			+7,200			
当座預金増減		▲35,200		+9,900		▲11,000
当座預金残高		4,116,600		4,126,500		4,115,500
準備預金残高		3,811,200				
積み終了先		3,811,200				
超過準備		3,811,200				
非準備先残高		305,400				
準備預金進捗率		100.0%				
平均		80.6%				
乖離率		19.4%				

国庫短期証券入札予定

9月11日	3ヶ月(第1406回)
9月16日	1年(第1407回)
9月17日	3ヶ月
9月25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	一回当たりオペファー金額	直近オペファー額	オペファー予定日					直近日	残り回数
1年以下	1,000	1,000	2	28				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10日の予定(時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
10:30	増日銀審議委員のあいさつ		(欧)	ラガルドECB総裁の 会見	
	-			-	
	-			-	

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9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(9/10~)						
1~3年	3,550	11,080	3,552	▲0.006	0.001	44.0
5~10年	3,350	7,862	3,354	▲0.006	▲0.005	67.9
25年~	750	1,884	752	0.018	0.021	18.3
国債補完供給(9/9~9/10)						
	454	454	0.500	0.500		
	10	10	0.500	0.500		

マネタリーベース [億円]

9月8日時点 5,343,200

所要

今積期の所要準備額		4,178,800
9月10日以降の残り所要		
積数		0
平均		0

国庫短期証券入札予定

9月11日	3ヶ月(第1406回)
9月16日	1年(第1407回)
9月17日	3ヶ月
9月25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	一回当たりオペファー金額	直近オペファー額	オペファー予定日					直近日	残り回数
1年以下	1,000	1,000	2	28				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	-