



短期市場の推移

[億円] [%]

	9月8日	9月9日	9月10日	9月11日
加重平均金利	0.977	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	104,696	105,234	106,124	107,188
ON	39,729	39,777	40,837	42,491
その他	64,967	65,457	65,287	64,697
有コール残	23,239	23,003	23,861	24,132

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	1.030	0.977	1.000
T/N	-	-	1.025	1.000
S/N	-	-	0.975	-
1W	-	-	1.055	1.000
2W	1.070	1.280	1.112	1.084
3W	-	-	-	1.131
1M	-	-	-	1.178
2M	-	-	1.380	-
3M	-	-	-	1.256
6M	-	-	-	1.357
1Y	-	-	-	1.533

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14日	9月15日	9月16日
券	▲200	▲200	+0
財政	+14,500	▲5,900	▲7,000
過不足	+14,300	▲6,100	▲7,000
金融調節	エンド	エンド	スタート
国債補完供給	+300	▲100	+100
貸出増加支援	▲34,400		
共通担保(全店)			▲8,000
当座預金増減	▲19,900	▲6,000	▲15,000
当座預金残高	4,097,400	4,091,400	4,076,400
準備預金残高	3,788,900	主な需給要因	
積み終了先	3,788,900	国債発行償還(個人)	国債発行(20年)
超過準備	3,788,900		
非準備先残高	308,500		
準備預金進捗率	100.0%		
平均	96.8%		
乖離率	3.2%		

国庫短期証券入札予定

9月16日	1年(第1407回)
9月17日	3ヶ月(第1408回)
9月25日	3ヶ月
10月2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				9月9日	1
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				9月9日	1
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				9月9日	1
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15日の予定(時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-		(米) FOMC(1日目)	
-		-	
-		-	

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14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(9/14~9/15)	208	208	0.500	0.500		
	0	0				

マネタリーベース [億円]

9月11日時点 5,307,400

所要

今積期の所要準備額 4,178,800

9月15日以降の残り所要

積数 0

平均 0