



短期市場の推移

	9月2日	9月3日	9月4日	9月5日
加重平均金利	0.227	0.227	0.227	0.227
東京レボレート(TN)	0.233	0.237	0.237	0.239
無コール残	77,956	77,759	75,165	76,560
ON	35,809	35,612	32,618	33,613
その他	42,147	42,147	42,547	42,947
有コール残	37,819	39,485	38,130	40,247

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意。
 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	0.215	0.228	0.227	0.243
T/N	-	-	-	0.241
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	-	0.198
2W	-	-	-	0.198
3W	-	-	-	0.196
1M	0.300	0.330	0.320	0.194
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	0.203
6M	-	-	-	0.254
1Y	-	-	-	0.319

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

9月9日の予定 (時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
8:50	4~6月の実質GDP (2次速報値)			-	
8:50	7月の国際収支			-	
	-			-	

本日の市況

無担保コールON物は0.228%の出合から始まり、その後は主に0.225%~0.228%を中心に取引された。ビットサイドの資金調達意欲は引き続き底堅く、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比横ばいの0.227%となった。

都銀・信託	証券	地銀
- ~ -	- ~ -	0.225 ~ 0.228

翌営業日のマーケット

ビットサイドの資金調達意欲は引き続き旺盛であり、出合の水準は本日対比横ばい圏を予想する。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	9月6日	9月9日	9月9日	9月10日	9月10日	9月10日
券		+300		+600		+1,000
財政		▲9,400		+8,600		+8,000
過不足		▲9,100		+9,200		+9,000
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				+6,200		
CP等買入	▲100		▲100			
社債等買入	▲100		▲300			
国債補充供給	+15,800	▲14,700	+14,700			
当座預金増減		▲8,200		+29,700		+9,000
当座預金残高		5,426,300		5,456,000		5,465,000
準備預金残高		4,862,600				主な需給要因
積み終了先		4,862,500	国庫短期証券発行償還		国庫短期証券発行償還	
超過準備		4,862,500	(3M)		(6M)	
非準備先残高		563,700				国債償還(物連10年)
準備預金進捗率		99.9%				
平均		77.4%				
乖離率		22.5%				

9月6日のオペ結果

【%】(億円)※米ドル資金供給は百万\$

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
国債買入(9/9~)						
5~10年	4,000	8,341	4,006	0.002	0.004	10.0
10~25年	1,500	2,461	1,504	0.005	0.008	99.2
25年~	750	1,611	753	0.003	0.005	11.9
国債補充供給(9/6~9/9)						
	15,005	15,005	▲0.050	▲0.050		
	0	0				

マネタリーベース 【億円】
 9月5日時点 6,677,100

所要	【億円】
今積期の所要準備額	4,071,500
9月9日以降の残り所要	
積数	200
平均	0

国庫短期証券入札予定

9月9日	6ヶ月(第1255回)
9月13日	3ヶ月(第1256回)
9月18日	1年
9月19日	3ヶ月
9月10日	5年
9月12日	20年
9月26日	40年
9月30日	2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	1500	1,500	4		9月4日 0
1年超3年以下	3500	3,500	4	11 18 25	9月4日 3
3年超5年以下	3750	3,750	4	11 18 25	9月4日 3
5年超10年以下	4000	4,000	6	11 18 25	9月6日 3
10年超25年以下	1500	1,500	6	18 25	9月6日 2
25年超	750	750	6	11	9月6日 1
物価連動債	600	600	25		8月28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