



短期市場の推移

[億円] [%]

	9月9日	9月10日	9月11日	9月12日
加重平均金利	0.477	0.477	0.480	0.477
東京レボレート(TN)	0.489	0.491	0.489	0.494
無コール残	86,791	85,009	88,472	87,313
ON	34,375	32,573	35,016	35,337
その他	52,416	52,436	53,456	51,976
有コール残	30,536	30,940	31,318	31,541

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	0.445	0.478	0.477	0.492
T/N	-	-	0.440	0.495
S/N	-	-	-	-
1W	0.484	0.530	0.499	0.482
2W	0.468	0.482	0.477	0.482
3W	-	-	-	0.480
1M	-	-	-	0.482
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	0.524
6M	-	-	-	0.570
1Y	-	-	-	0.675

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16日	9月17日	9月17日	9月18日	9月18日	9月18日
券		+300		+400		+0
財政		▲200		+2,300		▲9,000
過不足		+100		+2,700		▲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
共通担保(全店)			▲8,000	+8,000		
社債等買入			▲300			
国債補完供給	+1,800	▲2,500	+2,500			
当座預金増減		▲600		+4,900		▲9,000
当座預金残高		4,988,600		4,993,500		4,984,500
準備預金残高		4,563,400				
積み終了先		2,634,000				
超過準備		1,212,100				
非準備先残高		425,200				
準備預金進捗率		84.1%				
平均		3.3%				
乖離率		80.8%				

国庫短期証券入札予定

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
10月3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	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17日の予定(時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
8:50	8月の貿易収支		(米) FOMC(2日目)		
	-		(欧) ラガルドECB総裁の講演		
	-		(欧) 8月の消費者物価		

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。ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比横ばいの0.477%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

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16日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
------	------	----	----	----	----	----

米ドル資金供給(9/18~9/26)

1	1	4.360	4.360
---	---	-------	-------

国債補完供給(9/16~9/17)

2,634	2,634	0.250	0.250
-------	-------	-------	-------

共通担保(全店)(9/17~10/1)

8,000	17,428	8,003	45.9
-------	--------	-------	------

米ドル資金供給用担保国債供給(9/17~9/29)

5,000	2	2	0.470	0.470
-------	---	---	-------	-------

マネタリーベース [億円]

9月12日時点 6,205,200

所要

今積期の所要準備額 3,983,200

9月17日以降の残り所要

積数 631,900

平均 21,800

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