



短期市場の推移

	9月10日	9月11日	9月12日	9月16日
加重平均金利	0.477	0.480	0.477	0.477
東京レボレート(TN)	0.491	0.489	0.494	0.495
無コール残	85,009	88,472	87,313	86,427
ON	32,573	35,016	35,337	34,891
その他	52,436	53,456	51,976	51,536
有コール残	30,940	31,318	31,541	31,443

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	0.450	0.525	0.478	0.492
T/N	-	-	-	0.494
S/N	-	-	-	-
1W	0.484	0.520	0.496	0.483
2W	0.466	0.481	0.474	0.481
3W	-	-	-	0.481
1M	-	-	-	0.483
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	0.523
6M	-	-	-	0.571
1Y	-	-	-	0.684

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18日の予定(時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
日銀金融政策決定会合(1日目)		(欧) ラガルドECB総裁の講演	
-			
-			

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+0.001%の0.478%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。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	9月17日		9月18日		9月19日	
券	+500		▲100		+0	
財政	▲4,500		+3,600		+4,000	
過不足	▲4,000		+3,500		+4,000	
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				
CP等買入			▲300			
社債等買入	▲300					
国債補完供給	+2,500	▲800	+800			
当座預金増減	▲2,600		+4,000		+4,000	
当座預金残高	4,986,000		4,990,000		4,994,000	
準備預金残高	4,540,900		主な需給要因			
積み終了先	4,419,100		国債発行(20年)			
超過準備	4,003,100					
非準備先残高	445,100					
準備預金進捗率	97.1%					
平均	6.7%					
乖離率	90.4%					

9月17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(9/17~9/18)	798	798	0.250	0.250		
	0	0				

マネタリーベース [億円]

9月16日時点 6,204,300

所要

今積期の所要準備額	3,983,200
9月18日以降の残り所要	
積数	115,500
平均	4,100

国庫短期証券入札予定

9月18日	3ヶ月(第1333回)
9月26日	3ヶ月
10月3日	3ヶ月
10月9日	6ヶ月

国債入札予定

9月25日	40年
9月30日	2年
10月2日	10年
10月7日	30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	11	24		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	-

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