



短期市場の推移

[億円] [%]

	9月17日	9月18日	9月19日	9月22日
加重平均金利	0.478	0.477	0.477	0.476
東京レボ レート(TN)	0.494	0.491	0.493	0.492
無コール残	81,610	82,005	78,335	79,905
ON	31,868	31,913	30,913	32,199
その他	49,742	50,092	47,422	47,706
有コール残	26,109	26,479	26,682	28,168

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	0.490
T/N	-	-	-	0.491
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	0.485	0.478
2W	0.455	0.478	0.475	0.479
3W	-	-	-	0.480
1M	-	-	-	0.481
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	0.535
6M	-	-	-	0.583
1Y	-	-	-	0.704

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25日の予定 (時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
8:50	日銀金融政策決定会合議事要旨 (7月30・31日分)			(米) GDP (2Q、速報値)	
	-			(米) バーFRB理事の講演	
	-			(米) 8月の財の貿易収支	

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+0.002%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。

[%][億円]※米ドル資金供給は百万\$

資金需給

[億円]

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	9月24日		9月25日		9月26日	
券	+300		+100		+0	
財政	▲2,600		+5,600		▲10,000	
過不足	▲2,300		+5,700		▲10,000	
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				+11,000		
CP等買入	▲500					
社債等買入	▲200					
国債補完供給	+1,500	▲2,200	+2,200			

9月24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(9/25~)

1~3年	3,250	7,150	3,252	▲0.003	0.000	8.0
3~5年	3,250	5,488	3,252	▲0.005	▲0.002	78.4
5~10年	3,500	6,296	3,502	▲0.014	▲0.010	69.0
10~25年	1,350	3,545	1,352	▲0.017	▲0.014	26.4

米ドル資金供給(9/26~10/2)

	0	0	4.340	4.340
国債補完供給(9/24~9/25)	2,311	2,311	0.250	0.250
	0	0		

マネタリーベース [億円]

9月22日時点 6,253,900

所要

今積期の所要準備額	3,983,200
9月25日以降の残り所要	
積数	9,100
平均	400

国庫短期証券入札予定

9月26日	3ヶ月(第1334回)
10月3日	3ヶ月
10月9日	6ヶ月
10月10日	3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				9月3日	0
1年超3年以下	3250	3,250	3	11	24		9月24日	0
3年超5年以下	3250	3,250	3	24	29		9月24日	1
5年超10年以下	3500	3,500	11	24	29		9月24日	1
10年超25年以下	1350	1,350	3	11	24		9月24日	0
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