



短期市場の推移

[億円] [%]

	9月22日	9月24日	9月25日	9月26日
加重平均金利	0.476	0.478	0.477	0.476
東京レボレート(TN)	0.492	0.491	0.490	0.492
無コール残	79,905	84,167	81,003	81,513
ON	32,199	31,707	28,193	28,493
その他	47,706	52,460	52,810	53,020
有コール残	28,168	28,239	27,468	26,555

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	0.450	0.478	0.477	0.489
T/N	-	-	0.550	0.380
S/N	-	-	-	-
1W	0.475	0.590	0.524	0.468
2W	0.481	0.545	0.514	0.476
3W	-	-	-	0.479
1M	0.550	0.560	0.551	0.480
2M	-	-	-	-
3M	-	-	0.700	0.552
6M	-	-	-	0.594
1Y	-	-	-	0.711

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29日	9月30日	9月30日	10月1日	10月1日	10月1日
券		+300		+1,000		+1,000
財政		▲6,700		▲11,300		▲17,000
過不足		▲6,400		▲10,300		▲16,000
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				+7,700		
共通担保(全店)					▲8,000	
CP等買入	▲100		▲200			
国債補完供給	+1,000	▲1,800	+1,800			
当座預金増減		▲7,300		▲1,000		▲24,000
当座預金残高		5,032,100		5,031,100		5,007,100
準備預金残高		4,590,700				
積み終了先		4,590,600				
超過準備		4,590,200				
非準備先残高		441,400				
準備預金進捗率		99.9%				
平均		46.7%				
乖離率		53.2%				

国庫短期証券入札予定

10月3日	3ヶ月(第1335回)
10月9日	6ヶ月
10月10日	3ヶ月
10月16日	1年

国債入札予定

9月30日	2年
10月2日	10年
10月7日	30年
10月9日	5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24日	0
3年超5年以下	3250	3,250	3	24	29			9月29日	0
5年超10年以下	3500	3,500	11	24	29			9月29日	0
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29日	0
物価連動債	500	500	29					9月29日	0
変動利付債	-	300						4月14日	-

9月30日の予定(時刻は日本時間)

8:50	日本	予想	海外		予想
	金融政策決定会合における主な意見 (9月18日～19日開催)		(米) 消費者信頼感指数 (9月)		
	-		-		
	-		-		

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0.477%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29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(9/30～)

3～5年	3,250	6,973	3,257	▲0.014	▲0.012	18.2
5～10年	3,500	4,829	3,504	▲0.019	▲0.015	66.2
25年～	750	1,606	751	▲0.030	▲0.023	23.2
物価連動	500	1,991	500	▲0.020	▲0.143	85.0

国債補完供給(9/29～9/30)

	1,923	1,923	0.250	0.250
	0	0		

マネタリーベース [億円]

9月26日時点 6,253,300

所要

今積期の所要準備額	3,983,200
9月30日以降の残り所要	
積数	600
平均	0

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