



短期市場の推移

[億円] [%]

	9月9日	9月10日	9月11日	9月14日
加重平均金利	0.977	0.977	0.977	0.977
東京レポレート(TN)	1.000	1.000	1.000	1.000
無コール残	105,234	106,124	107,188	107,898
ON	39,777	40,837	42,491	43,211
その他	65,457	65,287	64,697	64,687
有コール残	23,003	23,861	24,132	23,816

加重平均金利・コール残高は日銀、東京レポ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、無担保コール残高は無担保コール残高の値

本日の短期市場金利

[%]

	無担保コール(速報)			レポ市場
	最低	最高	平均	東京レポレート
O/N	0.950	1.030	0.978	0.999
T/N	-	-	-	1.000
S/N	-	-	-	-
1W	0.983	1.000	0.994	1.000
2W	1.060	1.250	1.083	1.102
3W	-	-	-	1.148
1M	-	-	-	1.187
2M	1.350	1.390	1.384	-
3M	-	-	-	1.259
6M	-	-	-	1.366
1Y	-	-	-	1.541

無担保コール(速報)は日銀、東京レポ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15日	9月16日	9月16日	9月17日	9月17日	9月18日
券		▲200		▲700		+0
財政		▲7,300		+2,400		+0
過不足		▲7,500		+1,700		+0
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		
国債補完供給	+100	▲500	+500			
当座預金増減		▲7,900		+2,200		+0
当座預金残高		4,089,500		4,091,700		4,091,700
準備預金残高		3,777,500				
積み終了先		3,777,500				
超過準備		3,777,500				
非準備先残高		312,000				
準備預金進捗率		100.0%				
平均		100.0%				
乖離率		0.0%				

国庫短期証券入札予定

9月16日	1年(第1407回)
9月17日	3ヶ月(第1408回)
9月25日	3ヶ月
10月2日	3ヶ月
国債入札予定	
9月29日	40年
9月30日	2年
10月6日	10年
10月8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	1,000	1,000	2	9月2日	0
1年超3年以下	3,550	3,550	9 28	9月9日	1
3年超5年以下	3,200	3,200	2 16	9月2日	1
5年超10年以下	3,350	3,350	9 16	9月9日	1
10年超25年以下	1,000	1,000	2 28	9月2日	1
25年超	750	750	9 16	9月9日	1
物価連動債	300	300	28	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

9月16日の予定(時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
8:50	貿易収支(8月)		(米) FOMC(2日目)		
	-		(米) 小売売上高(8月)		
	-		(欧) 鉱工業生産(7月)		

本日の市況

無担保コールON物は0.977%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)は前営業対比+0.001%の0.978%となった。

都銀・信託	証券	地銀
- ~ -	0.977 ~ 0.977	0.977 ~ 0.977

翌営業日のマーケット

出合いの水準は本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15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(9/15~9/16)						
	497	497	0.500	0.500		
	0	0				
共通担保(全店)(9/16~9/30)						
	8,000	56,893	8,027		14.1	

マネタリーベース [億円]

9月14日時点 5,287,600

所要

所要		[億円]
来積期の所要準備額	4,028,000	
9月16日以降の残り所要		
積数	4,028,000	
平均	134,300	