



短期市場の推移

[億円] [%]

	9月10日	9月11日	9月14日	9月15日
加重平均金利	0.977	0.977	0.977	0.978
東京レポレート(TN)	1.000	1.000	1.000	1.000
無コール残	106,124	107,188	107,898	110,534
ON	40,837	42,491	43,211	46,177
その他	65,287	64,697	64,687	64,357
有コール残	23,861	24,132	23,816	24,309

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	1.025	0.977	1.000
T/N	-	-	-	1.000
S/N	-	-	-	-
1W	0.983	1.110	1.017	1.000
2W	-	-	1.490	1.119
3W	-	-	-	1.161
1M	-	-	-	1.195
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	1.262
6M	-	-	-	1.371
1Y	-	-	-	1.549

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16日		9月17日		9月18日	
券	▲700		▲1,300		+0	
財政	+1,500		+6,900		▲1,000	
過不足	+800		+5,600		▲1,000	
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			+6,800			
共通担保(全店)	▲8,000	+8,000				
国債補充供給	+500	▲300	+300			
当座預金増減	+1,000		+12,700		▲1,000	
当座預金残高	4,090,500		4,103,200		4,102,200	
準備預金残高	3,781,800		主な需給要因			
積み終了先	1,235,400					
超過準備	925,300					
非準備先残高	308,700					
準備預金進捗率	70.9%					
平均	3.3%					
乖離率	67.6%					

国庫短期証券入札予定

9月17日	3ヶ月(第1408回)
9月25日	3ヶ月
10月2日	3ヶ月
10月8日	6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	一回当たりオペ金額	直近オペ額	オペアー予定日				直近日	残り回数
1年以下	1,000	1,000	2	28			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16日	0
5年超10年以下	3,350	3,350	9	16			9月16日	0
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16日	0
物価連動債	300	300	28				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
日銀金融政策決定会合(1日目)			(米) 住宅着工件数(8月)		
-			(欧) ユーロ圏消費者物価(8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0.977%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
国債買入(9/17~)						
3~5年	3,200	5,266	3,202	▲0.022	▲0.016	34.1
5~10年	3,350	4,742	3,351	▲0.030	▲0.018	89.1
25年~	750	1,385	751	▲0.014	0.010	47.5
国債補充供給(9/16~9/17)						
	326	326	0.500	0.500		
	0	0				

マネタリーベース [億円]

9月15日時点 5,280,000

所要

[億円]

今積期の所要準備額	4,028,000
9月17日以降の残り所要	
積数	1,171,500
平均	40,400

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