



短期市場の推移

[億円][%]

	9月11日	9月14日	9月15日	9月16日
加重平均金利	0.977	0.977	0.978	0.977
東京レボ レート(TN)	1.000	1.000	1.000	1.000
無コール残	107,188	107,898	110,534	110,717
ON	42,491	43,211	46,177	46,290
その他	64,697	64,687	64,357	64,427
有コール残	24,132	23,816	24,309	24,065

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	0.950	1.030	0.977	1.000
T/N	-	-	1.100	1.000
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	-	1.030
2W	-	-	-	1.138
3W	-	-	-	1.174
1M	-	-	-	1.201
2M	-	-	-	-
3M	1.390	1.450	1.420	1.272
6M	-	-	-	1.378
1Y	-	-	-	1.564

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17日	9月18日	9月18日	9月24日	9月24日	9月24日
券		▲1,300	▲1,000		+1,000	
財政		+6,800	+3,900		+81,000	
過不足		+5,500	+2,900		+82,000	
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
国債補完供給	+300	▲400	+400			
国債買入		+6,800				
社債等買入			▲1,300			
当座預金増減		+12,200	+2,000		+82,000	
当座預金残高		4,102,700	4,104,700		4,186,700	
準備預金残高		3,802,800				
積み終了先		3,566,700				
超過準備		2,910,300				
非準備先残高		299,900				
準備預金進捗率		93.1%				
平均		6.7%				
乖離率		86.4%				

国庫短期証券入札予定

9月25日	3ヶ月
10月2日	3ヶ月
10月8日	6ヶ月
10月9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	一回当たりオペファー金額	直近オペファー額	オペファー予定日	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 (2日目)			(米) 鉱工業生産(8月)	
8:30	CPI(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)は前営業対比横ばいの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)	470	470	0.500	0.500		
	0	0				

マネタリーベース [億円]

9月16日時点 5,281,700

所要

今積期の所要準備額		4,028,000
9月18日以降の残り所要		
積数	278,900	
平均	10,000	

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