



短期市場の推移

[億円] [%]

	9月15日	9月16日	9月17日	9月18日
加重平均金利	0.978	0.977	0.977	0.977
東京レボ レート(TN)	1.000	1.000	1.000	1.249
無コール残	110,534	110,717	107,403	106,150
ON	46,177	46,290	43,916	44,254
その他	64,357	64,427	63,487	61,896
有コール残	24,309	24,065	23,847	26,030

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	1.200	1.228	1.227	1.246
T/N	-	-	-	1.250
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	1.500	1.250
2W	1.310	1.470	1.366	1.250
3W	-	-	1.310	1.250
1M	1.390	1.480	1.413	1.251
2M	-	-	1.380	-
3M	1.440	1.480	1.458	1.293
6M	-	-	-	1.397
1Y	-	-	-	1.584

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24日	9月25日	9月25日	9月28日	9月28日	9月28日
券		+700		+2,000		+0
財政		+79,400		▲5,000		▲2,500
過不足		+80,100		▲3,000		▲2,500
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	▲1,300	+1,300			
社債等買入			▲400			
当座預金増減		+79,100		▲2,100		▲2,500
当座預金残高		4,182,100		4,180,000		4,177,500
準備預金残高		3,872,100				
積み終了先		3,866,400				
超過準備		3,863,100				
非準備先残高		310,000				
準備預金進捗率		99.6%				
平均		30.0%				
乖離率		69.6%				

国庫短期証券入札予定

9月25日	3ヶ月(第1409回)
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	一回当たりオペ金額	直近オペ金額	オペ予定日	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	-

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25日の予定(時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
	-			-	
	-			-	
	-			-	

本日の市況

無担保コールON物は1.227%の出合から始まり、その後も同程度で推移した。本日より日銀当座預金の超過準備に1.25%の付利が適用され、付利金利との裁定を意識したレートに収束し、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.25%の1.227%となった。

</

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
国債補完供給(9/24~9/25)	1,540	1,540	0.700	0.700		
	13	13	0.700	0.700		

マネタリーベース [億円]

9月18日時点 5,296,600

所要

今積期の所要準備額 4,028,000

9月25日以降の残り所要

積数 14,100

平均 700