



短期市場の推移

[億円] [%]

	9月16日	9月17日	9月18日	9月24日
加重平均金利	0.977	0.977	0.977	1.227
東京レボ レート(TN)	1.000	1.000	1.249	1.250
無コール残	110,717	107,403	106,150	103,048
ON	46,290	43,916	44,254	45,888
その他	64,427	63,487	61,896	57,160
有コール残	24,065	23,847	26,030	27,127

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。無担保コール残高は無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	1.250
T/N	-	-	-	1.250
S/N	-	-	-	-
1W	1.200	1.520	1.304	1.250
2W	-	-	-	1.250
3W	-	-	-	1.250
1M	1.360	1.500	1.407	1.251
2M	1.450	1.490	1.483	-
3M	-	-	1.490	1.298
6M	-	-	-	1.402
1Y	-	-	-	1.595

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25日	9月28日	9月29日
券	+2,000	+800	+0
財政	▲8,100	+2,300	▲11,000
過不足	▲6,100	+3,100	▲11,000
金融調節	エンド	エンド	エンド
社債等買入	▲400		
国債補完供給	+1,300	+500	
当座預金増減	▲5,700	+3,600	▲11,000
当座預金残高	4,176,400	4,180,000	4,169,000
準備預金残高	3,873,200	主な需給要因	
積み終了先	3,872,600	国庫短期証券発行償還	各種財政資金の
超過準備	3,869,400	(3M)	貸付金回収
非準備先残高	303,200	流動性供給	
準備預金進捗率	99.9%		
平均	40.0%		
乖離率	59.9%		

国庫短期証券入札予定

10月2日	3ヶ月(第1410回)
10月8日	6ヶ月
10月9日	3ヶ月
10月16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28日の予定(時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
8:50	日銀金融政策決定会合議事 要旨(7/30~31日分)		-	
16:00	第120回国債市場 特別参加者会合		-	
	-		-	

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。ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比横ばいの1.227%となった。

都銀・信託	証券	地銀
- ~ -	1.227 ~ 1.227	1.227 ~ 1.227

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25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(9/25~9/28)	650	650	0.800	0.800		
	0	0				

マネタリーベース [億円]

9月24日時点 5,375,000

所要

今積期の所要準備額	4,028,000
9月28日以降の残り所要	
積数	2,700
平均	200