



短期市場の推移

[億円] [%]

	9月17日	9月18日	9月24日	9月25日
加重平均金利	0.977	0.977	1.227	1.227
東京レポレート(TN)	1.000	1.249	1.250	1.250
無コール残	107,403	106,150	103,048	113,507
ON	43,916	44,254	45,888	52,322
その他	63,487	61,896	57,160	61,185
有コール残	23,847	26,030	27,127	23,376

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	1.200	1.228	1.227	1.250
T/N	-	-	-	1.250
S/N	-	-	1.400	-
1W	-	-	1.220	1.250
2W	1.221	1.231	1.227	1.250
3W	-	-	-	1.250
1M	-	-	1.350	1.251
2M	-	-	1.410	-
3M	-	-	1.490	1.303
6M	-	-	-	1.409
1Y	-	-	-	1.604

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28日	9月29日	9月29日	9月30日	9月30日
券		+900	+700	+100	+100
財政		+2,400	▲10,000	▲3,000	▲3,000
過不足		+3,300	▲9,300	▲2,900	▲2,900
金融調節	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド
国債買入			+4,500		
社債等買入			▲100		
国債補完供給	+500	▲400	+400		
当座預金増減		+3,400	▲4,500	▲2,900	
当座預金残高		4,179,800	4,175,300	4,172,400	
準備預金残高		3,869,900			
積み終了先		3,869,200	各種財政資金の貸付金	主な需給要因	
超過準備		3,869,200	回収	国債発行(40年)	
非準備先残高		309,900			
準備預金進捗率		99.9%			
平均		43.3%			
乖離率		56.6%			

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28日	0
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28日	0
25年超	750	750	9 16	9月16日	0
物価連動債	300	300	28	9月28日	0
変動利付債	-	300	-	4月14日	-

9月29日の予定(時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-		(米) 消費者信頼感指数(9月)	
-		(米) ボウマンFRB副議長の講演	
-		-	

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28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(9/29~)						
1~3年	3,550	10,199	3,554	0.035	0.036	62.8
10~25年	1,000	3,816	1,003	0.015	0.018	29.5
物価連動	300	1,481	300	▲0.730	▲0.767	84.6
国債補完供給(9/28~9/29)						
	445	445	0.800	0.800		
	0	0				

マネタリーベース [億円]

9月25日時点 5,367,300

所要

今積期の所要準備額 4,028,000

9月29日以降の残り所要

積数 2,000

平均 100

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