



短期市場の推移

[億円] [%]

	9月18日	9月24日	9月25日	9月28日
加重平均金利	0.977	1.227	1.227	1.227
東京レボレート(TN)	1.249	1.250	1.250	1.250
無コール残	106,150	103,048	113,507	113,002
ON	44,254	45,888	52,322	53,807
その他	61,896	57,160	61,185	59,195
有コール残	26,030	27,127	23,376	22,308

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	1.229	1.227	1.248
T/N	-	-	-	1.250
S/N	-	-	-	-
1W	1.200	1.288	1.252	1.250
2W	1.228	1.350	1.248	1.250
3W	-	-	-	1.250
1M	1.290	1.380	1.344	1.251
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	1.309
6M	-	-	-	1.418
1Y	-	-	-	1.615

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29日	9月30日	10月1日
券	+700	+1,000	+0
財政	▲10,800	▲5,000	▲12,000
過不足	▲10,100	▲4,000	▲12,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国債補完供給	+400	▲200	+200
国債買入	▲100	+4,500	
社債等買入			
共通担保(全店)		▲8,000	+8,000
当座預金増減	▲5,500	▲3,800	▲12,000
当座預金残高	4,174,300	4,170,500	4,158,500
準備預金残高	3,863,000	主な需給要因	
積み終了先	3,862,900	国債発行(40年)	国債発行償還(2年)
超過準備	3,862,100		
非準備先残高	311,300		
準備預金進捗率	99.9%		
平均	46.7%		
乖離率	53.2%		

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30日	2年
10月6日	10年
10月8日	30年
10月14日	5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	-

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30日の予定(時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
8:50	鉱工業生産(8月)		(米) GDP(2Q)		
	-		(米) ADP雇用統計(9月)		
	-		(米) 個人消費支出(8月)		

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29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(9/29~9/30)						
	157	157	0.800	0.800		
	75	75	0.800	0.800		
共通担保(全店)(9/30~10/14)						
	8,000	20,000	8,000	40.0		

マネタリーベース [億円]

9月28日時点 5,369,800

所要

今積期の所要準備額 4,028,000

9月30日以降の残り所要

積数 1,100

平均 100