



短期市場の推移

	9月9日	9月10日	9月11日	9月12日
加重平均金利	0.227	0.228	0.227	0.229
東京レポレート(TN)	0.236	0.230	0.235	0.207
無コール残	75,562	80,226	79,717	79,240
ON	32,375	33,909	33,600	32,493
その他	43,187	46,317	46,117	46,747
有コール残	39,660	40,799	40,966	39,381

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、無コール残は無担保・有担保コール残高の意。

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	0.215	0.275	0.227	0.244
T/N	-	-	-	0.243
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	0.227	0.201
2W	-	-	-	0.198
3W	-	-	-	0.197
1M	0.340	0.430	0.388	0.198
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	0.203
6M	-	-	-	0.251
1Y	-	-	-	0.317

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

9月17日の予定 (時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
17:00	業態別の日銀当座預金残高(8月)		(米) FOMC (1日目)	
	-		(米) 鉱工業生産 (8月)	
	-		-	

本日の市況

無担保コールON物は0.228%の出合から始まり、その後は主に0.225%~0.228%を中心に取引された。ビッドサイドの資金調達意欲は引き続き底堅かったが、試し取り要因の剥落のためON物加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.002%の0.227%となった。

	都銀・信託	証券	地銀
	- ~ -	- ~ -	0.225 ~ 0.228

翌営業日のマーケット

新積み初日のため、ビッドサイドの資金調達意欲は旺盛と見込まれ、出合の水準は本日対比横ばい圏を予想する。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	9月13日	9月17日	9月17日	9月18日	9月18日	9月18日
券		▲100		+200		+0
財政		▲700		+7,400		▲7,000
過不足		▲800		+7,600		▲7,000
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
共通担保(全店)					▲8,000	
CP等買入	▲100		▲100			
社債等買入	▲100					
国債補充供給	+15,700	▲14,500	+14,500			
貸出増加支援	▲128,300	+121,500				
当座預金増減		▲6,600		+22,000		▲15,000
当座預金残高		5,418,400		5,440,400		5,425,400
準備預金残高		4,857,600				主な需給要因
積み終了先		4,857,600				国庫短期証券発行償還
超過準備		4,857,600				(3M)
非準備先残高		560,800				国債発行償還(個人)
準備預金進捗率		100.0%				
平均		100.0%				
乖離率		0.0%				

9月13日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
国債補充供給(9/13~9/17)	14,762	14,762	▲0.050	▲0.050		
	0	0				

マネタリーベース 【億円】
9月12日時点 6,666,500

所要	【億円】
来積期の所要準備額	3,940,700
9月17日以降の残り所要	
積数	462,800
平均	16,000

国庫短期証券入札予定

9月18日	1年(第1257回)
9月19日	3ヶ月(第1258回)
9月27日	3ヶ月
10月4日	3ヶ月
9月26日	40年
9月30日	2年
10月3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	1500	1,500	4	9月4日	0
1年超3年以下	3500	3,500	4 11 18 25	9月11日	2
3年超5年以下	3750	3,750	4 11 18 25	9月11日	2
5年超10年以下	4000	4,000	6 11 18 25	9月11日	2
10年超25年以下	1500	1,500	6 18 25	9月6日	2
25年超	750	750	6 11	9月11日	0
物価連動債	600	600	25	8月28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