



短期市場の推移

	[億円] [%]			
	9月11日	9月12日	9月13日	9月17日
加重平均金利	0.227	0.229	0.227	0.228
東京レボレート(TN)	0.235	0.207	0.243	0.245
無コール残	79,717	79,240	80,391	74,925
ON	33,600	32,493	33,674	32,815
その他	46,117	46,747	46,717	42,110
有コール残	40,966	39,381	40,337	40,500

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意。

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	0.218	0.275	0.228	0.243
T/N	-	-	-	0.239
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	-	0.205
2W	-	-	0.320	0.197
3W	-	-	-	0.198
1M	-	-	-	0.198
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	0.202
6M	-	-	-	0.252
1Y	-	-	-	0.318

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

9月19日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
日銀政策決定会合 (1日目)		(米) 景気先行指数 (8月)	
-		-	
-		-	

本日の市況

無担保コールON物は0.227%の出合から始まり、その後は主に0.225%~0.227%を中心に取引された。一部金融機関による試し取りに加え、ビッドサイドの資金調達意欲は引き続き底堅く、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比横ばいの0.228%となった。

[%]		
都銀・信託	証券	地銀
- ~ -	- ~ -	0.225 ~ 0.227

翌営業日のマーケット

ビッドサイドの資金調達意欲は引き続き旺盛であるため、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18日		9月19日		9月20日
券	+300		+0		+0
財政	▲3,100		+8,900		+48,000
過不足	▲2,800		+8,900		+48,000
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				+12,900	
共通担保(全店)	▲8,000	+8,000			
CP等買入	▲100		▲100		
社債等買入			▲300		
国債補充供給	+19,800	▲17,500	+17,500		
当座預金増減	▲600		+38,900		+48,000
当座預金残高	5,421,300		5,460,200		5,508,200
準備預金残高	4,883,000		主な需給要因		
積み終了先	4,868,200		国庫短期証券発行償還 (1Y)		
超過準備	4,846,500		国債大量償還 (5年・10年・20年)		
非準備先残高	538,300		利払い		
準備預金進捗率	98.8%		流動性供給		
平均乖離率	10.0%				
乖離率	88.8%				

9月18日のオペ結果

[%][億円] ※米ドル資金供給は百万\$

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
------	------	----	----	----	----	----

国債買入(9/19~)						
1~3年	3,500	11,546	3,503	▲0.008	▲0.007	98.3
3~5年	3,750	9,079	3,755	▲0.010	▲0.009	16.1
5~10年	4,000	6,277	4,003	▲0.009	▲0.004	17.8
10~25年	1,500	2,442	1,500	▲0.003	0.003	66.7

国債補充供給(9/18~9/19)						
	17,637	17,637	▲0.050	▲0.050		
	131	131	▲0.050	▲0.050		

マネタリーベース [億円]

9月17日時点 6,663,300

所要

[億円]	
今積期の所要準備額	3,940,700
9月19日以降の残り所要	
積数	46,100
平均	1,700

国庫短期証券入札予定

9月19日	3ヶ月(第1258回)
9月27日	3ヶ月
10月4日	3ヶ月
10月9日	6ヶ月
国債入札予定	
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18日	1
3年超5年以下	3750	3,750	4	11	18	25	9月18日	1
5年超10年以下	4000	4,000	6	11	18	25	9月18日	1
10年超25年以下	1500	1,500	6	18	25		9月18日	1
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