



短期市場の推移

	9月24日	9月25日	9月26日	9月27日
加重平均金利	0.226	0.226	0.226	0.226
東京レポレート(TN)	0.235	0.229	0.219	0.208
無コール残	76,618	71,912	72,159	68,695
ON	34,398	30,232	30,364	27,440
その他	42,220	41,680	41,795	41,255
有コール残	45,267	45,086	41,502	39,878

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)			レポ市場
	最低	最高	平均	東京レポレート
O/N	0.217	0.228	0.225	0.232
T/N	-	-	-	0.238
S/N	-	-	-	-
1W	0.227	0.269	0.232	0.199
2W	-	-	-	0.199
3W	-	-	-	0.198
1M	-	-	0.300	0.199
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	0.207
6M	-	-	-	0.250
1Y	-	-	-	0.318

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

10月1日の予定 (時刻は日本時間)

日本		予想	海外	予想
8:50	有効求人倍率 (8月)		(米) 製造業PMI (9月)	
8:50	金融政策決定会合における主な意見 (9月19日・9月20日)		(米) ISM製造業指数 (9月)	
8:50	日銀短観 (9月)		(欧) 製造業PMI (9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。期末要因による取り控えによってギブン地合いとなり、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.001%の0.225%となった。

都銀・信託		証券	地銀
- ~ -	0.226 ~ 0.227	0.225 ~ 0.227	

翌営業日のマーケット

月初ビッドサイドの調達意欲が戻ることが想定されるため、出合いの水準は本日対比若干の上昇を予想する。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	9月30日	10月1日	10月1日	10月2日	10月2日	10月2日
券		+500	▲500		+0	
財政		+9,300	▲25,200		▲53,000	
過不足		+9,800	▲25,700		▲53,000	
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	▲3,100	+4,000				
国債補完供給	+15,300	▲14,700	+14,700			
当座預金増減		+11,300	▲11,000		▲61,000	
当座預金残高		5,494,300	5,483,300		5,422,300	
準備預金残高		4,950,800			主な需給要因	
積み終了先		4,950,000	国債発行償還 (2年)	消費税・法人税・保険		
超過準備		4,950,000		揚げ		
非準備先残高		543,500				
準備預金進捗率		99.9%				
平均		50.0%				
乖離率		49.9%				

9月30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(9/30~10/1)	14,916	14,916	▲0.050	▲0.050		
	0	0				

マネタリーベース (億円)
9月27日時点 6,723,800

所要	(億円)
今積期の所要準備額	3,940,700
10月1日以降の残り所要	
積数	4,200
平均	300

国庫短期証券入札予定

10月4日	3ヶ月(第1260回)
10月9日	6ヶ月
10月11日	3ヶ月
10月17日	1年
10月3日	10年
10月8日	30年
10月10日	5年
10月22日	10年クワイアメント・トランジション

来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	2	9月4日	0
1年超3年以下	3250	3,500	2 7 11 18	9月25日	0
3年超5年以下	3250	3,750	2 7 18 28	9月25日	0
5年超10年以下	3750	4,000	7 11 18 28	9月25日	0
10年超25年以下	1500	1,500	7 11 28	9月25日	0
25年超	750	750	2 18	9月11日	0
物価連動債	600	600	28	9月25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