



短期市場の推移

	10月1日	10月4日	10月5日	10月6日
加重平均金利	▲0.018	▲0.017	▲0.015	▲0.012
東京レボレート(TN)	▲0.079	▲0.081	▲0.085	▲0.084
無コール残	142,713	136,189	137,707	139,087
ON	69,555	58,876	58,744	60,274
その他	73,158	77,313	78,963	78,813
有コール残	17,270	18,473	18,486	18,057

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	▲0.045	0.001	▲0.009	▲0.083
T/N	-	-	-	▲0.082
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.025	▲0.001	▲0.012	▲0.084
2W	▲0.013	▲0.008	▲0.010	▲0.086
3W	-	-	-	▲0.092
1M	▲0.010	0.150	0.007	▲0.098
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.109
6M	-	-	-	▲0.121
1Y	-	-	-	▲0.131

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	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	10月7日		10月8日		10月11日	
券	▲300		+300		+0	
財政	+4,200		+5,700		▲17,000	
過不足	+3,900		+6,000		▲17,000	
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
CP等買入	▲200		▲200			
社債等買入						+1,300
国債補完供給	+200	▲800	+800			
当座預金増減	+3,100		+6,600		▲15,700	
当座預金残高	5,346,200		5,352,800		5,337,100	
準備預金残高	4,737,600		4,737,500		4,737,500	
積み終了先	4,737,500		4,737,500		4,737,500	
超過準備	4,737,500		4,737,500		4,737,500	
非準備先残高	608,600		608,600		608,600	
準備預金進捗率	100.0%		100.0%		100.0%	
平均	73.3%		73.3%		73.3%	
乖離率	26.7%		26.7%		26.7%	

10月7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

国債補完供給(10/7~10/8)

731 731 ▲0.350 ▲0.350
0 0

マネタリーベース [億円]

10月6日時点 6,559,900

所要

今積期の所要準備額 3,615,700

10月8日以降の残り所要

積数 0

平均 0

国庫短期証券入札予定

10月8日	3ヶ月(第1029回)
10月15日	3ヶ月
10月19日	1年
10月21日	6ヶ月

国債入札予定

10月12日	30年
10月14日	5年
10月19日	20年
10月27日	2年

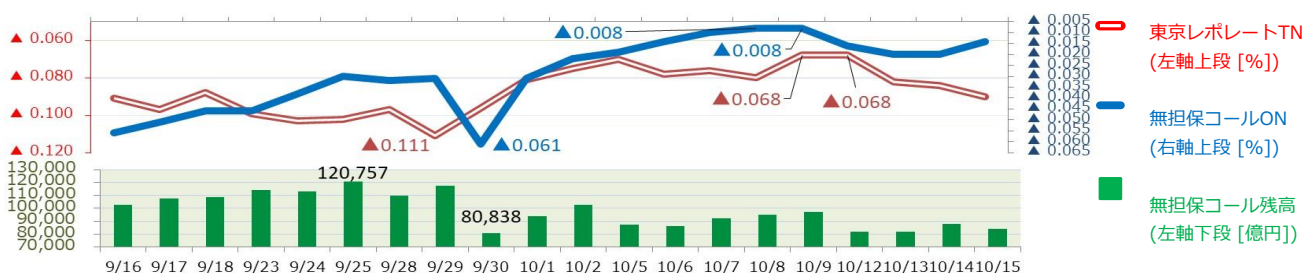
今月の国債買入オペ予定

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	月1回	9月8日	1
1年超3年以下	4500	4,500	4 8 13 20	10月4日	3
3年超5年以下	4500	4,500	4 8 20 26	10月4日	3
5年超10年以下	4250	4,250	8 13 20 26	9月29日	4
10年超25年以下	1500	1,500	4 20	10月4日	0
25年超	500	500		9月24日	1
物価連動債	600	600	月1回	9月29日	1
変動利付債<四半期>	300	300	四半期に1回	7月7日	1

1年前の市場推移

○2020年9月積み期 [9月16日~10月15日]

※積み初日及び積み最終日が祝日・休日の場合は、前営業日のレート・残高を記載しています。



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