



短期市場の推移

	10月4日	10月5日	10月6日	10月7日
加重平均金利	▲0.017	▲0.015	▲0.012	▲0.009
東京レボレート(TN)	▲0.081	▲0.085	▲0.084	▲0.082
無コール残	136,189	137,707	139,087	145,385
ON	58,876	58,744	60,274	66,022
その他	77,313	78,963	78,813	79,363
有コール残	18,473	18,486	18,057	18,002

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	▲0.050	0.001	▲0.008	▲0.084
T/N	-	-	-	▲0.080
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.005	▲0.001	▲0.004	▲0.083
2W	-	-	-	▲0.088
3W	-	-	-	▲0.093
1M	▲0.002	0.150	0.049	▲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

10月11日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	(米) 休日 (株式と商品は通常取引)	-
-	-	-	-
-	-	-	-

経済指標及び予想値は株式会社フィスコ提供

本日の市況

本日の無担保コールON物は▲0.010%の合出から始まり、その後は主に▲0.015%~▲0.003%の水準で合出が見られた。出会い水準はほぼ横ばいとなり、同加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.001%の▲0.008%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.010 ~ ▲0.010	▲0.010 ~ ▲0.010	▲0.010 ~ ▲0.003

翌営業日のマーケット

一部調達ニーズが減退する先が想定され、出合の水準は本日対比若干の低下を予想。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想
	10月8日	10月11日	10月11日	10月12日	10月12日
券		+300	+600	+0	+0
財政		+7,200	▲25,700	+2,000	+2,000
過不足		+7,500	▲25,100	+2,000	+2,000
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			+14,800		
CP等買入	▲200		▲200		
社債等買入			+1,300		
国債補充供給	+800	▲400	+400		
当座預金増減		+7,700	▲8,800	+2,000	+2,000
当座預金残高		5,353,900	5,345,100	5,347,100	5,347,100
準備預金残高		4,767,900			
積み終了先		4,767,900	国庫短期証券発行・償還(3M・6M)		
超過準備		4,767,900			
非準備先残高		586,000			
準備預金進捗率		100.0%			
平均		83.3%			
乖離率		16.7%			

10月8日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
国債買入(10/11~)						
~1年	1,500	5,538	1,503	0.004	0.007	35.0
1~3年	4,500	15,211	4,509	0.003	0.003	97.7
3~5年	4,500	12,344	4,504	0.005	0.006	64.9
5~10年	4,250	9,069	4,256	0.011	0.011	77.2
国債補充供給(10/8~10/11)						
	414	414	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マネタリーベース (億円)
 10月7日時点 6,563,300

所要	(億円)
今積期の所要準備額	3,615,700
10月11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15日	3ヶ月(第1030回)
10月19日	1年
10月21日	6ヶ月
10月22日	3ヶ月
10月12日	30年
10月14日	5年
10月19日	20年
10月27日	2年

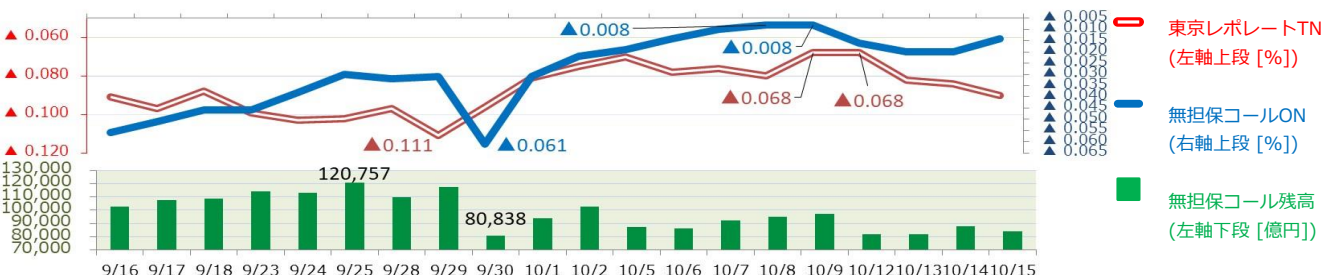
今月の国債買入オペ予定

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	10月8日	0
1年超3年以下	4500	4,500	4 8 13 20	10月8日	2
3年超5年以下	4500	4,500	4 8 20 26	10月8日	2
5年超10年以下	4250	4,250	8 13 20 26	10月8日	3
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