



### 短期市場の推移

	10月6日	10月7日	10月8日	10月11日
加重平均金利	▲0.012	▲0.009	▲0.008	▲0.021
東京レポレート(TN)	▲0.084	▲0.082	▲0.080	▲0.083
無コール残	139,087	145,385	139,036	139,305
ON	60,274	66,022	62,723	62,532
その他	78,813	79,363	76,313	76,773
有コール残	18,057	18,002	18,000	18,335

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	▲0.070	0.001	▲0.032	▲0.088
T/N	-	-	-	▲0.092
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	▲0.003	▲0.092
2W	-	-	▲0.002	▲0.095
3W	-	-	-	▲0.097
1M	▲0.008	▲0.002	▲0.003	▲0.101
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.110
6M	-	-	-	▲0.120
1Y	-	-	-	▲0.130

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13日の予定 (時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
8:50	8月コア機械受注 [前月比]	+1.5%	18:00	(欧)8月鉱工業生産指数 [前月比]	-1.5%
	-		21:30	(米)9月消費者物価 コア指数[前年比]	4.0%
	-			(米) 週間 MBA住宅 ローン申請指数	-

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▲0.015%の出合から始まり、その後は主に▲0.065%~▲0.010%の水準で出合が見られた。昨日と同様にビッドサイドの調達ニーズは弱く、軟調な地合となったため、同加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.011%の▲0.032%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.065 ~ ▲0.060	▲0.030 ~ ▲0.030	▲0.060 ~ ▲0.003

### 翌営業日のマーケット

ビッドサイドの調達ニーズは引き続き弱く、出合水準は本日対比低下を予想。

### 資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	10月12日	10月13日	10月13日	10月14日	10月14日	10月15日
券	+200	+100	+100	+0		
財政	+10,300	▲6,300	▲6,300	+3,000		
過不足	+10,500	▲6,200	▲6,200	+3,000		
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
国庫短期証券買入				+1,000		
共通担保(全店)			▲4,000	+2,400		
CP等買入	▲100		▲100			
国債補完供給	+100					
当座預金増減	+10,500	▲6,900	▲6,900	+3,000		
当座預金残高	5,352,900	5,346,000	5,346,000	5,349,000		
準備預金残高	4,743,500	主な需給要因				
積み終了先	4,743,500	源泉税揚げ				
超過準備	4,743,500	国債発行				
非準備先残高	609,400	(30年)				
準備預金進捗率	100.0%					
平均	90.0%					
乖離率	10.0%					

### 10月12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
国庫短期証券買入(10/13~)	1,000	9,764	1,000	0.010	0.010	
米ドル資金供給(10/14~10/21)	0	0	0.330	0.330		
国債補完供給(10/12~10/13)	17	17	▲0.350	▲0.350		
共通担保(全店)(10/13~10/27)	20,000	2,351	2,351			

マネタリーベース [億円]  
10月11日時点 6,558,700

所要	今積期の所要準備額
10月13日以降の残り所要	3,615,800
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(第1031回)
10月21日	6ヶ月
10月22日	3ヶ月

### 国債入札予定

10月14日	5年
10月19日	20年
10月27日	2年
11月1日	10年

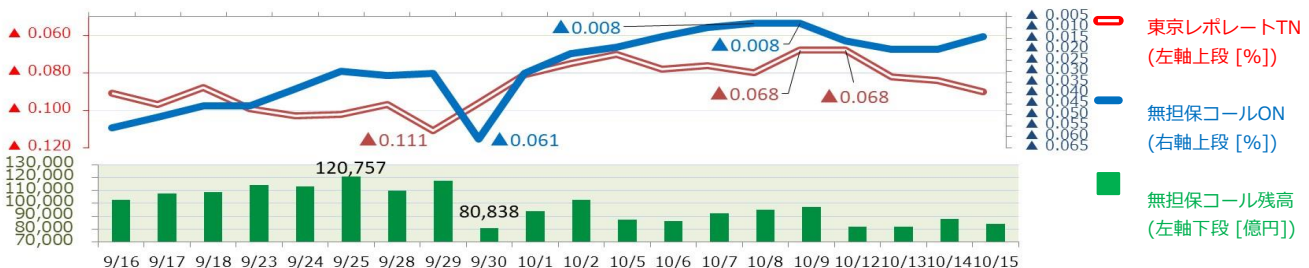
### 今月の国債買入オペ予定

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	10月4日	0
25年超	500	500	20	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