



短期市場の推移

[億円] [%]

	10月7日	10月8日	10月11日	10月12日
加重平均金利	▲0.009	▲0.008	▲0.021	▲0.032
東京レボレート(TN)	▲0.082	▲0.080	▲0.083	▲0.092
無コール残	145,385	139,036	139,305	138,007
ON	66,022	62,723	62,532	61,214
その他	79,363	76,313	76,773	76,793
有コール残	18,002	18,000	18,335	17,612

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	▲0.075	0.001	▲0.040	▲0.106
T/N	-	-	▲0.001	▲0.124
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	▲0.002	▲0.110
2W	▲0.045	▲0.003	▲0.037	▲0.109
3W	-	-	-	▲0.108
1M	-	-	▲0.005	▲0.107
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.112
6M	-	-	-	▲0.120
1Y	-	-	-	▲0.130

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14日の予定 (時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
	-		21:30	(米)9月生産者物価コア指数 [前年比]	7.1%
	-		21:30	(米)新規失業保険申請件数 [前週分]	-
	-			(米)フィラデルフィア連銀 総裁の講演	

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▲0.040%の出合から始まり、その後は主に▲0.070%～▲0.025%の水準で出合が見られた。ビッドサイドの一部で調達を控える動きも見られ、同加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.008%の▲0.040%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.075 ~ ▲0.075	▲0.050 ~ ▲0.040	▲0.065 ~ ▲0.003

翌営業日のマーケット

ビッドサイドの調達ニーズの弱まりから、出合の水準は本日対比で低下すると予想。

資金需給

[億円]

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想
	10月13日		10月14日		10月15日
券	+100		▲900		▲1,000
財政	▲4,700		+4,100		+49,000
過不足	▲4,600		+3,200		+48,000
金融調節	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド
国庫短期証券買入	+1,000		+9,300		スタート
国債買入	▲4,000		▲300		
共通担保(全店)	+2,400				
CP等買入	▲100				
当座預金増減	▲5,300		+12,200		+48,000
当座預金残高	5,347,600		5,359,800		5,407,800
準備預金残高	4,727,300		4,727,300		4,727,300
積み終了先	4,727,300		4,727,300		4,727,300
超過準備	4,727,300		4,727,300		4,727,300
非準備先残高	620,300		620,300		620,300
準備預金進捗率	100.0%		100.0%		100.0%
平均	93.3%		93.3%		93.3%
乖離率	6.7%		6.7%		6.7%

10月13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(10/14~)

1~3年	4,500	12,464	4,505	▲0.004	▲0.002	3.3
5~10年	4,250	9,304	4,262	▲0.006	▲0.005	43.3
変動利付	300	730	300	▲1.200	▲1.208	

CP等買入(10/18~)

5,000	9,242	4,990	▲0.015	▲0.010	63.7
-------	-------	-------	--------	--------	------

国債補完供給(10/13~10/14)

16	16	▲0.350	▲0.350
0	0		

マネタリーベース [億円]

10月12日時点 6,569,000

所要

今積期の所要準備額 3,615,800

10月14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(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
9月2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13日	1
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13日	2
10年超25年以下	1500	1,500	4 20	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	10月13日	0

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