



短期市場の推移

	10月8日	10月11日	10月12日	10月13日
加重平均金利	▲0.008	▲0.021	▲0.032	▲0.040
東京レポレート(TN)	▲0.080	▲0.083	▲0.092	▲0.124
無コール残	139,036	139,305	138,007	143,526
ON	62,723	62,532	61,214	67,053
その他	76,313	76,773	76,793	76,473
有コール残	18,000	18,335	17,612	17,193

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	▲0.086	0.001	▲0.052	▲0.127
T/N	-	-	▲0.059	▲0.135
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.002	▲0.001	▲0.002	▲0.114
2W	▲0.045	▲0.001	▲0.025	▲0.111
3W	▲0.004	▲0.001	▲0.003	▲0.109
1M	▲0.001	0.012	0.010	▲0.109
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.113
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15日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
【記者会見要旨】 野口審議委員 (10月14日分)	-	(欧)8月貿易収支	-
-	-	(米)10月ニューヨーク連銀 製造業景気指数	25
-	-	(米)9月小売売上高	-0.2%

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▲0.080%~▲0.020%の水準で出合が見られた。ビッドサイドの調達意欲は弱く、出合水準は昨日より低下。同加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.012%の▲0.052%と2021年6月30日(▲0.050%)以来約4か月ぶりの低水準となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.080 ~ ▲0.070	▲0.060 ~ ▲0.060	▲0.070 ~ ▲0.003

翌営業日のマーケット

ビッドサイドの調達意欲は限定的であり、軟調な地合になると予想。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	10月14日		10月15日		10月18日	
券	▲900		+200		+0	
財政	+2,700		+56,800		+0	
過不足	+1,800		+57,000		+0	
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
国債買入	+9,300					
CP等買入	▲300		▲400			+5,000
社債等買入			▲200			
国債補完供給		▲100	+100			
当座預金増減	+10,700		+56,500		+5,000	
当座預金残高	5,358,300		5,414,800		5,419,800	
準備預金残高	4,732,100		主な需給要因			
積み終了先	4,732,100		年金定時払い		国庫短期証券	
超過準備	4,732,100		国債発行(5年)		発行・償還(3M)	
非準備先残高	626,200					
準備預金進捗率	100.0%					
平均	96.7%					
乖離率	3.3%					

10月14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(10/14~10/15)	91	91	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マネタリーベース (億円)
10月13日時点 6,563,600

所要	(億円)
今積期の所要準備額	3,615,800
10月15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(第1032回)
10月22日	3ヶ月

国債入札予定

10月19日	20年
10月27日	2年
11月1日	10年
11月4日	物価連動

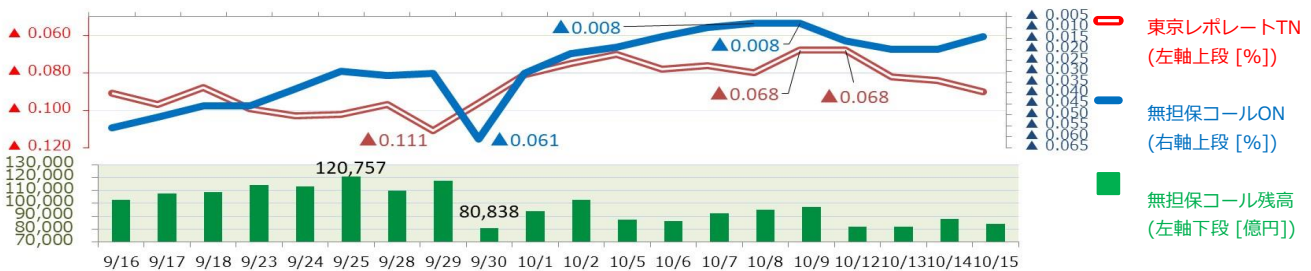
今月の国債買入オペ予定

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	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