



短期市場の推移

	9月28日	9月29日	9月30日	10月3日
加重平均金利	▲0.068	▲0.066	▲0.073	▲0.065
東京レボレート(TN)	▲0.092	▲0.118	▲0.097	▲0.100
無コール残	146,887	143,967	102,783	140,224
ON	80,190	78,260	64,030	83,281
その他	66,697	65,707	38,753	56,943
有コール残	32,315	32,493	30,413	30,327

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	▲0.080	0.001	▲0.059	▲0.106
T/N	-	-	-	▲0.116
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.070	▲0.038	▲0.064	▲0.116
2W	▲0.065	▲0.003	▲0.061	▲0.123
3W	-	-	-	▲0.129
1M	-	-	-	▲0.136
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.162
6M	-	-	-	▲0.151
1Y	-	-	-	▲0.144

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5日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	21:15 (米)9月ADP全米雇用報告	20.0万人
-	-	21:30 (米)8月貿易収支	-677億米ドル
-	-	23:00 (米)9月ISM非製造業景況指数	56.0

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▲0.065%の合出から始まり、その後は主に▲0.065%~▲0.060%の水準で取引された。大手行を中心に積極的に調達を行う先もあり、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.006%の▲0.059%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.060 ~ ▲0.060	▲0.065 ~ ▲0.060	▲0.065 ~ ▲0.055

翌営業日のマーケット

ビッドサイドの調達意欲は引き続き強く、出合水準は本日対比で上昇すると予想。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	10月4日	10月5日	10月5日	10月6日	10月6日	10月6日
券		+300		▲200		▲1,000
財政		▲43,100		▲30,100		+0
過不足		▲42,800		▲30,300		▲1,000
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		
CP等買入	▲100		▲100			
国債補完供給	+17,900	▲15,900	+15,900			
当座預金増減		▲40,900		▲13,500		▲1,000
当座預金残高		4,879,800		4,866,300		4,865,300
準備預金残高		4,243,200				
積み終了先		4,242,300				
超過準備		4,242,300				
非準備預金先高		636,600				
準備預金進捗率		99.9%				
平均		63.3%				
乖離率		36.6%				

10月4日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
国庫短期証券買入(10/5~)	1,000	5,078	1,000	0.003	0.004	
国債買入(固定利回り方式)(10/5~)						
5~10年		0	0			
5~10年		0	0			
米ドル資金供給(10/6~10/13)		0	0	3.330	3.330	
国債補完供給(10/4~10/5)		15,874	15,874	▲0.350	▲0.350	
		0	0			

マネタリーベース [億円]
 10月3日時点 6,170,500

所要	所要
今積期の所要準備額	3,750,600
10月5日以降の残り所要	
積数	2,100
平均	200

国庫短期証券入札予定

10月6日	6ヶ月(第1112回)
10月7日	3ヶ月(第1113回)
10月14日	3ヶ月
10月19日	1年
10月12日	30年
10月14日	5年
10月18日	20年
10月27日	2年

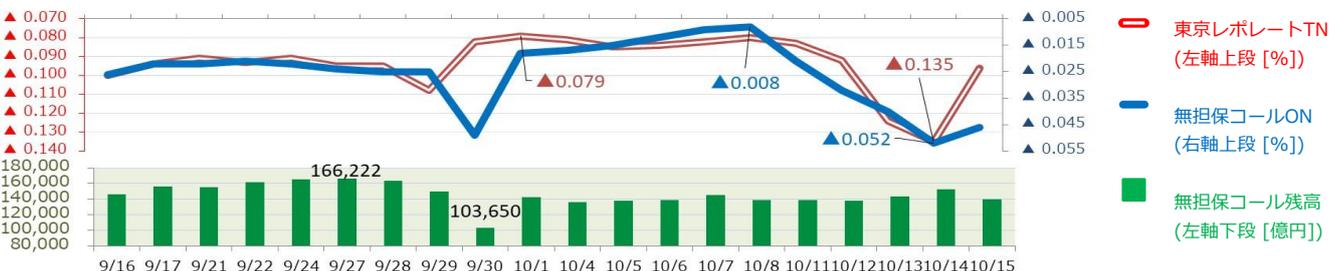
今月の国債買入オペ予定

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7日	1
1年超3年以下	4750	4,750	5 11 17 21	9月26日	4
3年超5年以下	4750	4,750	5 11 21 26	9月30日	4
5年超10年以下	5500	5,500	11 17 21 26	9月30日	4
10年超25年以下	2500	1,250	11 26	9月30日	2
25年超	1000	500	17 26	9月30日	2
物価連動債	600	600	月1回	9月30日	1
変動利付債<四半期>	300	300	四半期に1回	7月13日	1

1年前の市場推移

○2021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