



### 短期市場の推移

	9月30日	10月3日	10月4日	10月5日
加重平均金利	▲0.073	▲0.065	▲0.059	▲0.052
東京レポレート(TN)	▲0.097	▲0.100	▲0.116	▲0.129
無コール残	102,783	140,224	132,827	150,944
ON	64,030	83,281	71,439	83,126
その他	38,753	56,943	61,388	67,818
有コール残	30,413	30,327	31,975	32,249

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	▲0.075	0.001	▲0.039	▲0.098
T/N	▲0.040	▲0.035	▲0.036	▲0.113
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.065	0.008	▲0.048	▲0.121
2W	▲0.060	0.180	▲0.012	▲0.125
3W	▲0.060	▲0.059	▲0.059	▲0.130
1M	▲0.060	0.200	▲0.011	▲0.134
2M	-	-	0.020	-
3M	-	-	-	▲0.164
6M	-	-	-	▲0.150
1Y	-	-	-	▲0.144

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7日の予定 (時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
15:00	9月のコール市場残高(日銀)		21:30	(米)9月非農業部門雇用者数	25.0万人
			21:30	(米)9月失業率	3.7%

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▲0.045%の出合から始まり、その後は主に▲0.045%~▲0.035%の水準で取引された。大手行を中心に調達ニーズの高まりは継続し、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.013%の▲0.039%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.045 ~ ▲0.040	▲0.045 ~ ▲0.035	▲0.045 ~ ▲0.035

### 翌営業日のマーケット

週末4日積みとなることもあり、出合水準は一層の上昇を予想。

### 資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	10月6日	10月7日	10月7日	10月11日	10月11日	10月11日
券	▲800		▲100		+0	
財政	▲100		▲4,800		▲8,000	
過不足	▲900		▲4,900		▲8,000	
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
国債買入		+11,300		+300		
CP等買入	▲100		▲200			
社債等買入			▲200			
国債補完供給	+16,100	▲17,100	+17,100			
当座預金増減	+9,300		+12,100		▲8,000	
当座預金残高	4,859,500		4,871,600		4,863,600	
準備預金残高	4,224,000		主な需給要因			
積み終了先	4,224,000					
超過準備	4,223,100					
非準備先残高	635,500		流動性供給		国庫短期証券発行償還(3M・6M)	
準備預金進捗率	99.9%					
平均	70.0%					
乖離率	29.9%					

### 10月6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(固定利回り方式)(10/7~)						
5~10年	320	320				
5~10年	0	0				
国債補完供給(10/6~10/7)						
	16,984	16,984	▲0.350	▲0.350		
	7	7	▲0.350	▲0.350		

マネタリーベース (億円)  
10月5日時点 6,099,900

所要 (億円)  
今積期の所要準備額 3,750,600  
10月7日以降の残り所要  
積数 200  
平均 0

### 国庫短期証券入札予定

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21日	3ヶ月
10月12日	30年
10月14日	5年
10月18日	20年
10月27日	2年

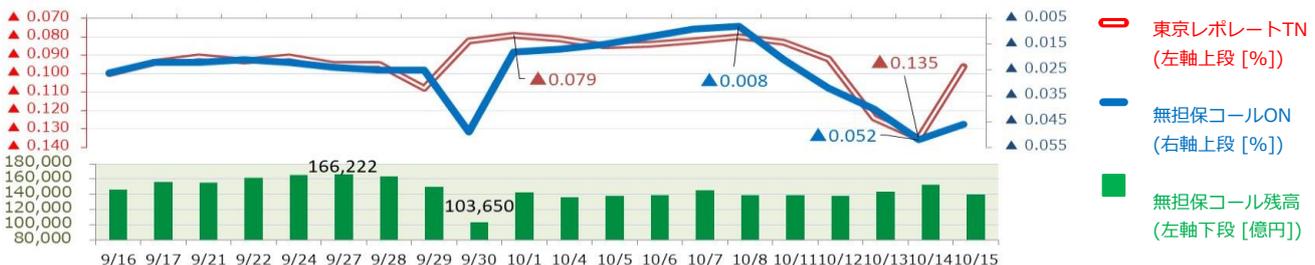
### 今月の国債買入オペ予定

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	10月5日	0
1年超3年以下	4750	4,750	5 11 17 21	10月5日	3
3年超5年以下	4750	4,750	5 11 21 26	10月5日	3
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