



短期市場の推移

	9月26日	9月29日	9月30日	10月1日
加重平均金利	0.476	0.477	0.477	0.477
東京レボレート(TN)	0.492	0.380	0.493	0.493
無コール残	81,513	79,988	75,970	80,275
ON	28,493	27,741	26,968	28,990
その他	53,020	52,247	49,002	51,285
有コール残	26,555	26,055	24,227	24,628

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	0.450	0.530	0.477	0.491
T/N	-	-	-	0.491
S/N	-	-	-	-
1W	0.525	0.610	0.545	0.483
2W	0.471	0.481	0.477	0.483
3W	-	-	-	0.483
1M	-	-	-	0.486
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	0.571
6M	-	-	-	0.610
1Y	-	-	-	0.721

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

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	10月2日	10月3日	10月3日	10月6日	10月6日	10月6日
券		+100	▲300		+0	
財政		▲39,100	▲27,700		+2,000	
過不足		▲39,000	▲28,000		+2,000	
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
国債補完供給	+3,000	▲3,500	+3,500			
当座預金増減		▲39,500	▲24,500		+2,000	
当座預金残高		4,948,400	4,923,900		4,925,900	
準備預金残高		4,495,700		主な需給要因		
積み終了先		4,495,600		国庫短期証券発行償還		
超過準備		4,495,600		(3M)		
非準備先残高		452,700				
準備預金進捗率		99.9%				
平均		56.7%				
乖離率		43.2%				

10月2日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
国債補完供給(10/2~10/3)	3,492	3,492	0.250	0.250		
	201	201	0.250	0.250		

マネタリーベース (億円)
 10月1日時点 6,201,800

所要 (億円)
 今積期の所要準備額 3,983,200
 10月3日以降の残り所要
 積数 400
 平均 0

10月3日の予定 (時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
8:30	完全失業率 (8月)		(米) 雇用統計 (9月) (発表延期の可能性も)	
8:30	有効求人倍率 (8月)		-	
10:05	植田日銀総裁のあいさつ		-	

本日の市況

無担保コールON物は0.477%の出合から始まり、その後も同程度で推移した。ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比横ばいの0.477%となった。

	都銀・信託	証券	地銀
	- ~ -	0.477 ~ 0.477	0.477 ~ 0.477

翌営業日のマーケット

出合いの水準は本日対比横ばい圏を予想する。

国庫短期証券入札予定

10月3日	3ヶ月(第1335回)
10月9日	6ヶ月(第1336回)
10月10日	3ヶ月
10月16日	1年
10月7日	30年
10月9日	5年
10月15日	20年
10月21日	10年プライマート・トランザクション

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	1000	1,000	8		9月3日 1
1年超3年以下	3000	3,250	8 16 22		9月24日 3
3年超5年以下	2800	3,250	16 22 28		9月29日 3
5年超10年以下	3050	3,500	8 16 28		9月29日 3
10年超25年以下	1150	1,350	8 22 28		9月24日 3
25年超	750	750	16 28		9月29日 2
物価連動債	500	500	28		9月29日 1
変動利付債	-	300	-		4月14日 -

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