



短期市場の推移

[億円] [%]

	9月30日	10月1日	10月2日	10月3日
加重平均金利	0.477	0.477	0.477	0.477
東京レボレート(TN)	0.493	0.493	0.491	0.494
無コール残	75,970	80,275	80,266	83,758
ON	26,968	28,990	27,772	30,620
その他	49,002	51,285	52,494	53,138
有コール残	24,227	24,628	25,091	25,672

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	0.450	0.530	0.477	0.492
T/N	-	-	-	0.493
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	-	0.483
2W	0.470	0.475	0.473	0.483
3W	-	-	-	0.482
1M	-	-	-	0.488
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	0.556
6M	-	-	-	0.607
1Y	-	-	-	0.711

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

[億円]

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	10月6日		10月7日		10月8日	
券	+700		+500		+0	
財政	+5,900		▲400		▲13,000	
過不足	+6,600		+100		▲13,000	
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	+1,300	▲1,000	+1,000			
社債等買入			▲100			

国庫短期証券入札予定

10月9日	6ヶ月(第1336回)
10月10日	3ヶ月(第1337回)
10月16日	1年
10月17日	3ヶ月

国債入札予定

10月7日	30年
10月9日	5年
10月15日	20年
10月21日	10年クワイメート・トランジション

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	-

10月7日の予定(時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
14:00	景気動向指数(速報/8月)		(米)貿易収支(8月)		
14:00	消費活動指数(8月)		(米)ボウマンFRB副議長講演		
15:00	コール市場残高(9月)		-		

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。

[%][億円]※米ドル資金供給は百万\$

10月6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(10/6~10/7)

981	981	0.250	0.250
54	54	0.250	0.250

マネタリーベース [億円]

10月3日時点 6,138,600

所要

[億円]

今積期の所要準備額 3,983,200

10月7日以降の残り所要

積数 100

平均 0

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