



短期市場の推移

[億円] [%]

	10月1日	10月2日	10月3日	10月6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	0.491	0.494	0.493
無コール残	80,275	80,266	83,758	86,181
ON	28,990	27,772	30,620	30,913
その他	51,285	52,494	53,138	55,268
有コール残	24,628	25,091	25,672	25,299

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重。

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	0.489
T/N	-	-	-	0.492
S/N	-	-	-	-
1W	0.485	0.510	0.489	0.483
2W	0.460	0.481	0.470	0.483
3W	-	-	-	0.482
1M	-	-	-	0.490
2M	-	-	-	-
3M	-	-	0.610	0.552
6M	-	-	-	0.606
1Y	-	-	-	0.710

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7日	10月8日	10月8日	10月9日	10月9日	10月9日
券		+600	+200		▲1,000	
財政		+900	▲11,000		+3,000	
過不足		+1,500	▲10,800		+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
社債等買入	▲100					
国債補充供給	+1,000	▲2,900	+2,900			
当座預金増減		▲500	▲7,900		+2,000	
当座預金残高		4,931,100	4,923,200		4,925,200	
準備預金残高		4,474,300			主な需給要因	
積み終了先		4,474,300			国債発行 (30年)	
超過準備		4,474,300				
非準備先残高		456,800				
準備預金進捗率		99.9%				
平均		73.3%				
乖離率		26.6%				

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9日	5年
10月15日	20年
10月21日	10年クライメート・トランジション
10月31日	2年

今月の国債買入オペ予定

オペ種類	一回当たりオペファー金額	直近オペファー額	オペファー予定日	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8日の予定 (時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
8:50	国際収支 (8月)			(米) FOMC議事録 (9月16日・17日開催分)	
	-			-	
	-			-	

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7日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
------	------	----	----	----	----	----

米ドル資金供給(10/9~10/16)

0 0 4.350 4.350

国債補充供給(10/7~10/8)

2,910 2,910 0.250 0.250

79 79 0.250 0.250

マネタリーベース [億円]

10月6日時点 6,144,900

所要

[億円]

今積期の所要準備額 3,978,100

10月8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