



短期市場の推移

	10月3日	10月6日	10月7日	10月8日
加重平均金利	0.477	0.477	0.477	0.477
東京レボレート(TN)	0.494	0.493	0.492	0.492
無コール残	83,758	86,181	86,827	87,940
ON	30,620	30,913	31,569	32,262
その他	53,138	55,268	55,258	55,678
有コール残	25,672	25,299	24,967	25,966

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	0.478	0.492
T/N	-	-	-	0.494
S/N	-	-	-	-
1W	0.530	0.560	0.537	0.485
2W	0.475	0.480	0.478	0.483
3W	-	-	-	0.483
1M	0.530	0.540	0.533	0.492
2M	-	-	-	-
3M	-	-	0.610	0.554
6M	-	-	-	0.612
1Y	-	-	-	0.716

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10日の予定 (時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
8:50	企業物価指数 (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+0.001%の0.478%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。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想
	10月9日		10月10日		10月14日
券		▲400		+200	+0
財政		▲400		▲21,800	+2,000
過不足		▲800		▲21,600	+2,000
金融調節	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド
国債買入		+8,000			
社債等買入			▲100		
国債補完供給	+2,800	▲2,000	+2,000		
当座預金増減		+8,000		▲19,700	+2,000
当座預金残高		4,930,900		4,911,200	4,913,200
準備預金残高		4,485,600	主な需給要因		
積み終了先		4,485,500	国庫短期証券発行償還	国庫短期証券発行償還	
超過準備		4,485,500	(6M)	(3M)	
非準備先残高		445,300	国債発行 (5年)		
準備預金進捗率		100.0%			
平均		80.0%			
乖離率		20.0%			

10月9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 (10/9~10/10)						
	2,156	2,112	0.250	0.249		
	0	0				

マナリーベース (億円)
10月8日時点 6,135,300

所要	所要
今積期の所要準備額	3,978,100
10月10日以降の残り所要	
積数	0
平均	0

国庫短期証券入札予定

10月10日	3ヶ月(第1337回)
10月16日	1年(第1338回)
10月17日	3ヶ月
10月24日	3ヶ月
国債入札予定	
10月15日	20年
10月21日	10年クライマート・トランジション
10月31日	2年
11月5日	10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	1000	1,000	8		10月8日 0	
1年超3年以下	3000	3,000	8	16	22	10月8日 2
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	3,050	8	16	28	10月8日 2
10年超25年以下	1150	1,150	8	22	28	10月8日 2
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