



短期市場の推移

	10月7日	10月8日	10月9日	10月10日
加重平均金利	0.477	0.477	0.478	0.477
東京レボレート(TN)	0.492	0.492	0.494	0.498
無コール残	86,827	87,940	89,120	80,152
ON	31,569	32,262	33,512	28,624
その他	55,258	55,678	55,608	51,528
有コール残	24,967	25,966	26,178	26,967

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	0.496
T/N	-	-	-	0.498
S/N	-	-	-	-
1W	0.484	0.550	0.500	0.488
2W	0.478	0.540	0.483	0.487
3W	-	-	-	0.489
1M	-	-	0.590	0.494
2M	-	-	-	-
3M	0.610	0.620	0.618	0.551
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15日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
13:30	鉱工業生産 (8月)	(米) ウォラーFRB理事の講演	
	-	(米) ページュブック	
	-	(米) CPI (8月) (発表延期の可能性も)	

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。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	10月14日	10月15日	10月15日	10月16日	10月16日	10月17日
券		+0	+300	+0	+0	+0
財政	▲12,400	+73,400	▲12,400	+73,400	▲8,000	▲8,000
過不足	▲12,400	+73,400	▲12,400	+73,400	▲8,000	▲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
共通担保(全店)			▲8,000	+8,000		
CP等買入			▲100			
社債等買入	▲100		▲100			
国債補充供給	+1,300	▲1,100	+1,100			
当座預金増減	▲12,300	+74,600	▲12,300	+74,600	▲8,000	▲8,000
当座預金残高	4,896,800	4,971,400	4,896,800	4,971,400	4,896,800	4,971,400
準備預金残高	4,457,800		4,457,800		4,457,800	
積み終了先	4,457,800		源泉税揚げ		源泉税揚げ	
超過準備	4,457,800		年金定時払い		年金定時払い	
非準備先残高	439,000		国債発行償還(個人)		国債発行(20年)	
準備預金進捗率	100.0%					
平均	96.7%					
乖離率	3.3%					

10月14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(10/16~10/23)	1	1	4.350	4.350		
国債補充供給(10/14~10/15)	1,188	1,188	0.250	0.250		
共通担保(全店)(10/15~10/29)	8,000	16,681	8,009		48.0	

マナリーベース	所要
10月10日時点 6,121,800	今積期の所要準備額 3,978,100
	10月15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16日	1年 (第1338回)
10月17日	3ヶ月 (第1339回)
10月24日	3ヶ月
10月31日	3ヶ月
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
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