



短期市場の推移

	10月9日	10月10日	10月14日	10月15日
加重平均金利	0.478	0.477	0.477	0.477
東京レボレート(TN)	0.494	0.498	0.498	0.498
無コール残	89,120	80,152	78,189	80,027
ON	33,512	28,624	27,187	27,115
その他	55,608	51,528	51,002	52,912
有コール残	26,178	26,967	26,770	26,441

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	0.478	0.477	0.494
T/N	-	-	-	0.497
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	0.550	0.489
2W	0.470	0.600	0.487	0.488
3W	-	-	0.525	0.489
1M	-	-	-	0.495
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	0.547
6M	-	-	-	0.613
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

資金需給

[億円]

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	10月16日		10月17日		10月20日	
券	+400		▲200		+1,000	
財政	▲7,600		+3,200		▲7,000	
過不足	▲7,200		+3,000		▲6,000	
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
国債買入				+9,500		
国債補充供給	+1,500	▲1,600	+1,600			

国庫短期証券入札予定

10月17日	3ヶ月(第1339回)
10月24日	3ヶ月
10月31日	3ヶ月
11月6日	6ヶ月
国債入札予定	
10月21日	10年クワイエット・トランジション
10月31日	2年
11月5日	10年
11月11日	30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	-

10月17日の予定(時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
15:35	内田日銀副総裁の挨拶 (全国信用組合大会)			(米) 鉱工業生産(9月)	
	-			(米) 住宅着工件数(9月) (発表延期の可能性)	
	-			(欧) 消費者物価(確報) (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16日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
国債補充供給(10/16~10/17)						
	1,678	1,678	0.250	0.250		
	5	5	0.250	0.250		
国債買入(10/17~)						
1~3年	3,000	6,313	3,004	0.013	0.014	82.9
3~5年	2,800	5,475	2,802	0.012	0.016	29.6
5~10年	3,050	7,199	3,056	0.005	0.007	11.5
25年	750	1,414	750	-0.066	-0.045	66.7

マネタリーベース [億円]

10月15日時点 6,180,300

所要

今積期の所要準備額	4,104,100
10月17日以降の残り所要	
積数	708,900
平均	23,600

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