



短期市場の推移

[億円] [%]

	9月25日	9月28日	9月29日	9月30日
加重平均金利	1.227	1.227	1.227	1.226
東京レボ レート(TN)	1.250	1.250	1.250	1.250
無コール残	113,507	113,002	114,777	100,363
ON	52,322	53,807	55,072	45,179
その他	61,185	59,195	59,705	55,184
有コール残	23,376	22,308	22,122	21,994

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	1.200	1.280	1.227	1.250
T/N	-	-	1.280	1.250
S/N	-	-	-	-
1W	1.225	1.310	1.259	1.250
2W	1.300	1.380	1.348	1.250
3W	-	-	-	1.250
1M	1.283	1.650	1.340	1.251
2M	-	-	-	-
3M	-	-	1.500	1.315
6M	-	-	-	1.432
1Y	-	-	-	1.631

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1日	10月2日	10月5日
券	+100	+400	+0
財政	▲27,500	▲45,200	+3,000
過不足	▲27,400	▲44,800	+3,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国債補完供給	+1,000		
当座預金増減	▲26,400	▲44,800	+3,000
当座預金残高	4,140,100	4,095,300	4,098,300
準備預金残高	3,828,000	主な需給要因	
積み終了先	3,827,800	法人税、消費税、	国庫短期証券発行償還
超過準備	3,827,800	保険揚げ	(3M)
非準備先残高	312,100		
準備預金進捗率	99.9%		
平均	53.3%		
乖離率	46.6%		

国庫短期証券入札予定

10月2日	3ヶ月(第1410回)
10月8日	6ヶ月(第1411回)
10月9日	3ヶ月
10月16日	3ヶ月

国債入札予定

10月6日	10年
10月8日	30年
10月14日	5年
10月20日	20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	1,000	1,000	7					9月2日	1
1年超3年以下	3,300	3,550	7	21				9月28日	2
3年超5年以下	2,900	3,200	16	28				9月16日	2
5年超10年以下	3,050	3,350	21	28				9月16日	2
10年超25年以下	850	1,000	7	16				9月28日	2
25年超	750	750	16	21				9月16日	2
物価連動債	300	300	28					9月28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

10月2日の予定(時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
8:30	完全失業率(8月)		(米)雇用統計(9月)		
8:30	有効求人倍率(8月)		(欧)ユーロ圏CPI(9月)		
8:30	東京都都区CPI(9月中旬)				

本日の市況

無担保コールON物は1.227%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1.227%となった。

都銀・信託		証券	地銀	
-	~	1.227 ~ 1.227	1.227	~ 1.227

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1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(10/1~10/2)

74	74	0.800	0.800
0	0		

マネタリーベース [億円]

9月30日時点 5,354,700

所要

[億円]

今積期の所要準備額	4,028,000
10月2日以降の残り所要	
積数	800
平均	100