



短期市場の推移

[億円] [%]

	9月28日	9月29日	9月30日	10月1日
加重平均金利	1.227	1.227	1.226	1.227
東京レボレート(TN)	1.250	1.250	1.250	1.250
無コール残	113,002	114,777	100,363	114,789
ON	53,807	55,072	45,179	53,550
その他	59,195	59,705	55,184	61,239
有コール残	22,308	22,122	21,994	22,583

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	1.229	1.227	1.250
T/N	-	-	-	1.250
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	1.360	1.250
2W	1.233	1.234	1.233	1.250
3W	-	-	-	1.250
1M	1.300	1.520	1.378	1.252
2M	-	-	1.380	-
3M	-	-	-	1.314
6M	-	-	-	1.435
1Y	-	-	-	1.635

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2日	10月5日	10月5日	10月6日	10月6日	10月6日
券		+500	+900	+300		
財政		▲45,400	+9,300	+2,000		
過不足		▲44,900	+10,200	+2,300		
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
当座預金増減		▲44,900	+10,200	+2,300		
当座預金残高		4,095,200	4,105,400	4,107,700		
準備預金残高		3,776,400				
積み終了先		3,776,300				
超過準備		3,776,300				
非準備先残高		318,800				
準備預金進捗率		99.9%				
平均		63.3%				
乖離率		36.6%				

国庫短期証券入札予定

10月8日	6ヶ月(第1411回)
10月9日	3ヶ月(第1412回)
10月16日	3ヶ月
10月19日	1年

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 -

10月5日の予定(時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
			(米) サービス業PMI (9月、確報)		
			(米) ISM非製造業指数 (9月)		
			(欧) サービス業PMI (9月、確報)		

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)は前営業日対比横ばいの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2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(10/2~10/5)

78	78	0.800	0.800
0	0		

マネタリーベース [億円]

10月1日時点 5,328,200

所要

今積期の所要準備額		4,028,000
10月5日以降の残り所要		
積数		400
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