



短期市場の推移

[億円] [%]

	9月29日	9月30日	10月1日	10月2日
加重平均金利	1.227	1.226	1.227	1.227
東京レポレート(TN)	1.250	1.250	1.250	1.250
無コール残	114,777	100,363	114,789	114,979
ON	55,072	45,179	53,550	52,020
その他	59,705	55,184	61,239	62,959
有コール残	22,122	21,994	22,583	21,870

加重平均金利・コール残高は日銀、東京レポ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、無担保コール残高は無担保コール残高の値。

本日の短期市場金利

[%]

	無担保コール(速報)			レポ市場
	最低	最高	平均	東京レポレート
O/N	1.200	1.280	1.227	1.246
T/N	-	-	-	1.250
S/N	-	-	-	-
1W	1.225	1.310	1.250	1.250
2W	1.227	1.231	1.230	1.250
3W	-	-	-	1.250
1M	-	-	-	1.252
2M	-	-	-	-
3M	1.500	1.520	1.507	1.314
6M	-	-	-	1.436
1Y	-	-	-	1.636

無担保コール(速報)は日銀、東京レポ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5日	10月6日	10月7日
券	+900	+700	+200
財政	+12,600	▲900	▲26,000
過不足	+13,500	▲200	▲25,800
金融調節	エンド	スタート	エンド
国債補完供給	▲100	+100	
当座預金増減	+13,400	▲100	▲25,800
当座預金残高	4,108,600	4,108,500	4,082,700
準備預金残高	3,778,900	主な需給要因 国債発行(10年)	
積み終了先	3,778,800		
超過準備	3,778,800		
非準備先残高	329,700		
準備預金進捗率	99.9%		
平均	66.7%		
乖離率	33.2%		

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年超3年以下	3,300	3,550	7	21	9月28日
3年超5年以下	2,900	3,200	16	28	9月16日
5年超10年以下	3,050	3,350	21	28	9月16日
10年超25年以下	850	1,000	7	16	9月28日
25年超	750	750	16	21	9月16日
物価連動債	300	300	28		9月28日
変動利付債	-	300	-		4月14日

10月6日の予定(時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
15:35	植田日銀総裁のあいさつ		(米) 貿易収支(8月)		
			(米) ボウマンFRB副議長の講演		

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5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(10/5~10/6)	140	140	0.800	0.800		
	0	0				

マネタリーベース [億円]

10月2日時点 5,282,800

所要

今積期の所要準備額	4,028,000
10月6日以降の残り所要	
積数	300
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