



短期市場の推移

[億円] [%]

	9月30日	10月1日	10月2日	10月5日
加重平均金利	1.226	1.227	1.227	1.227
東京レボレート(TN)	1.250	1.250	1.250	1.250
無コール残	100,363	114,789	114,979	116,840
ON	45,179	53,550	52,020	52,061
その他	55,184	61,239	62,959	64,779
有コール残	21,994	22,583	21,870	23,553

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	-	-	-	1.250
S/N	-	-	-	-
1W	1.225	1.350	1.230	1.250
2W	-	-	1.228	1.250
3W	-	-	-	1.250
1M	1.335	1.350	1.343	1.253
2M	-	-	-	-
3M	-	-	1.500	1.314
6M	-	-	-	1.436
1Y	-	-	-	1.638

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6日		10月7日		10月8日		
券	+700	+200		+0		
財政	▲1,000	▲25,700		+1,000		
過不足	▲300	▲25,500		+1,000		
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
国債補完供給	+100					
	</					

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8日	30年
10月14日	5年
10月20日	20年
10月29日	2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	-

[億円]

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7日の予定(時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
15:00	コール市場残高(9月)		(米) 9月15~16日のFOMC議事録		
	-		-		
	-		-		

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6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(10/6~10/7)						
	25	25	0.800	0.800		
	0	0				

マネタリーベース [億円]

10月5日時点 5,295,300

所要

[億円]

今積期の所要準備額	4,028,000
10月7日以降の残り所要	
積数	300
平均	0