



短期市場の推移

[億円] [%]

	10月1日	10月2日	10月5日	10月6日
加重平均金利	1.227	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	114,789	114,979	116,840	114,454
ON	53,550	52,020	52,061	50,115
その他	61,239	62,959	64,779	64,339
有コール残	22,583	21,870	23,553	22,897

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	1.288	1.236	1.250
2W	1.232	1.330	1.265	1.250
3W	-	-	1.320	1.250
1M	-	-	1.400	1.254
2M	-	-	-	-
3M	-	-	1.500	1.315
6M	-	-	-	1.440
1Y	-	-	-	1.641

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7日	10月8日	10月8日	10月9日	10月9日	10月9日
券		+200	▲200			+0
財政		▲23,800	+1,800			▲6,000
過不足		▲23,600	+1,600			▲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				+4,900		
社債等買入			▲100			
当座預金増減		▲23,600	+6,400			▲6,000
当座預金残高		4,084,800	4,091,200			4,085,200
準備預金残高		3,757,300				
積み終了先		3,757,200				
超過準備		3,757,200				
非準備先残高		327,500				
準備預金進捗率		99.9%				
平均		73.3%				
乖離率		26.6%				

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	一回当たりオペファー金額	直近オペファー額	オペファー予定日	直近日	残り回数
1年以下	1,000	1,000	7	10月7日	0
1年超3年以下	3,300	3,300	7 21	10月7日	1
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	850	7 16	10月7日	1
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8日の予定(時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
8:50	国際収支(8月)		(米)ウォラーFRB理事の講演		
14:00	さくらレポート		-		
	-		-		

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7日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
国債買入(10/8~)						
~1年	1,000	4,909	1,002	0.011	0.020	55.7
1~3年	3,300	8,031	3,303	0.006	0.007	61.7
10~25年	850	3,350	852	▲0.013	▲0.008	22.3
国債補完供給(10/7~10/8)						
	79	79	0.800	0.800		
	0	0				

マネタリーベース [億円]

10月6日時点 5,294,500

所要

今積期の所要準備額		4,032,500
10月8日以降の残り所要		
積数	200	
平均	0	

[億円]