上田八木短資

デイリーシグナル

2026年10月9日(金)

短期市場の推移 [億円] [%]

	10月5日	10月6日	10月7日	10月8日
加重平均金利	1.227	1.227	1.227	1.228
東京レポレート(TN)	1.250	1.250	1.250	1.250
無コール残	116,840	114,454	117,489	117,117
ON	52,061	50,115	52,215	49,383
その他	64,779	64,339	65,274	67,734
有コール残	23,553	22,897	22,996	23,333

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・有コール残は無担保・有担保コール残高の意。

10月13日の予定 (時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
8:50	企業物価指数(9月)			(米)ウォラーFRB理事の講演	
	-			-	
	-			-	

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	1.190	1.250	1.227	1.250
T/N	-	-	-	1.251
S/N	-	-	-	-
1W	1.226	1.310	1.239	1.250
2W	-	-	1.231	1.250
3W	-	-	-	1.250
1M	-	-	1.350	1.256
2M	-	-	-	-
3M	-	-	1.500	1.316
6M	-	-	-	1.442
1Y	-	-	-	1.645

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

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$

資金需給 [億円]

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	10月9日		10月13日		10月14日	
券	▲100		+0		+0	
財政	▲5,300		+14,700		▲2,000	
過不足	▲5,400		+14,700		▲2,000	
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	+200	▲100	+100			
社債等買入	▲200		▲200			
共通担保(全店)					▲8,000	
当座預金増減	▲5,500		+14,600		▲10,000	
当座預金残高	4,082,100		4,096,700		4,086,700	
準備預金残高	3,769,500		主な需給要因			
積み終了先	3,769,500		国庫短期証券発行償還			
超過準備	3,769,400		(3M・6M)			
非準預先残高	312,600					
準備預金進捗率	100.0%					
平均	90.0%					
乖離率	10.0%					

10月9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(10/9～10/13)						
	82	82	0.800	0.800		
	0	0				

マネタリーベース [億円]

10月8日時点	5,273,600

所要 [億円]

今積期の所要準備額	4,032,500
10月13日以降の残り所要	
積数	0
平均	0

国庫短期証券入札予定

10月16日	3ヶ月(第1413回)
10月19日	1年 (第1414回)
10月23日	3ヶ月
10月29日	3ヶ月

国債入札予定

10月14日	5年
10月20日	20年
10月29日	2年
11月2日	5年クライメート・トランジション

今月の国債買入オペ予定 [億円]

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						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