



短期市場の推移

[億円] [%]

	10月6日	10月7日	10月8日	10月9日
加重平均金利	1.227	1.227	1.228	1.227
東京レボレート(TN)	1.250	1.250	1.250	1.251
無コール残	114,454	117,489	117,117	115,507
ON	50,115	52,215	49,383	48,068
その他	64,339	65,274	67,734	67,439
有コール残	22,897	22,996	23,333	22,857

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	1.228	1.250
T/N	-	-	-	1.250
S/N	-	-	-	-
1W	1.225	1.230	1.226	1.250
2W	1.310	1.350	1.333	1.250
3W	-	-	-	1.250
1M	-	-	-	1.256
2M	-	-	-	1.400
3M	-	-	-	1.314
6M	-	-	-	1.444
1Y	-	-	-	1.645

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13日	10月14日	10月15日
券	+0	+600	+0
財政	+16,400	▲1,400	+63,000
過不足	+16,400	▲800	+63,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国債補完供給	+100	▲100	+100
社債等買入	▲200	▲100	▲100
共通担保(全店)		▲8,000	+8,000
当座預金増減	+16,200	▲800	+63,000
当座預金残高	4,098,300	4,097,500	4,160,500
準備預金残高	3,782,100	主な需給要因	
積み終了先	3,782,100	国債発行(5年)	
超過準備	3,782,100	国債発行償還(個人)	
非準備先残高	316,200	源泉所得税揚げ	
準備預金進捗率	100.0%	年金定時払い	
平均	93.3%		
乖離率	6.7%		

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

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

10月14日の予定(時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
8:50	マネーストック(9月)		(米)ボウマンFRB副議長の講演		
	-		(米)CPI(9月)		
	-		(米)ページブック		

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1.228%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13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(10/13~10/14)						
	174	174	0.800	0.800		
	0	0				
共通担保(全店)(10/14~10/28)						
	8,000	20,948	8,009	38.2		

マネタリーベース [億円]

10月9日時点 5,268,300

所要

[億円]

今積期の所要準備額	4,032,500
10月14日以降の残り所要	
積数	0
平均	0

[億円]