



短期市場の推移

[億円] [%]

	10月8日	10月9日	10月13日	10月14日
加重平均金利	1.228	1.227	1.228	1.228
東京レポレート(TN)	1.250	1.251	1.250	1.250
無コール残	117,117	115,507	115,689	112,512
ON	49,383	48,068	47,425	44,258
その他	67,734	67,439	68,264	68,254
有コール残	23,333	22,857	23,060	22,677

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重。

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	1.228	1.250
T/N	-	-	-	1.250
S/N	-	-	-	-
1W	1.225	1.310	1.230	1.250
2W	1.288	1.360	1.315	1.250
3W	-	-	-	1.250
1M	-	-	-	1.254
2M	-	-	-	-
3M	1.480	1.500	1.484	1.317
6M	-	-	-	1.443
1Y	-	-	-	1.644

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15日	10月16日	10月19日
券	+0	+400	▲500
財政	+64,800	▲100	+5,000
過不足	+64,800	+300	+4,500
金融調節	エンド	スタート	エンド
国債補完供給	+100	+300	スタート
社債等買入	▲300	▲200	
当座預金増減	+64,600	+400	+4,500
当座預金残高	4,159,700	4,160,100	4,164,600
準備預金残高	3,857,500	主な需給要因	
積み終了先	3,857,500	国庫短期証券発行償還 (3M)	
超過準備	3,857,500		
非準備先残高	302,200		
準備預金進捗率	100.0%		
平均	100.0%		
乖離率	0.0%		

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20日	20年
10月29日	2年
11月2日	5年(クライマート・トランジション)
11月5日	10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		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16日の予定(時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
15:30	植田日銀総裁のあいさつ		(欧) 貿易収支(8月)	
17:00	業態別の日銀当座預金残高(9月)		-	
	-		-	

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1.228%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15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(10/15~10/16)						
	419	419	0.800	0.800		
	21	21	0.800	0.800		

マネタリーベース [億円]

10月14日時点 5,280,500

所要

来積期の所要準備額	4,163,000
10月16日以降の残り所要	
積数	4,163,000
平均	134,300