



### 短期市場の推移

	9月25日	9月26日	9月27日	9月30日
加重平均金利	0.226	0.226	0.226	0.225
東京レポレート(TN)	0.229	0.219	0.208	0.238
無コール残	71,912	72,159	68,695	68,331
ON	30,232	30,364	27,440	30,501
その他	41,680	41,795	41,255	37,830
有コール残	45,086	41,502	39,878	38,592

### 10月2日の予定 (時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
8:50	日銀短観 (調査全容・9月)		(米)ADP雇用統計(9月)	
	-		-	
	-		-	

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、無コール残は無担保・有担保コール残高の意。  
 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	0.220	0.290	0.227	0.242
T/N	-	-	-	0.239
S/N	-	-	-	-
1W	0.234	0.390	0.250	0.202
2W	0.227	0.400	0.270	0.200
3W	-	-	-	0.200
1M	0.280	0.285	0.283	0.200
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	0.207
6M	-	-	-	0.252
1Y	-	-	-	0.318

### 本日の市況

無担保コールON物は0.227%の出合から始まり、その後は主に0.225%~0.227%を中心に取引された。ビットサイドの資金調達意欲は引き続き底堅く、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.002%の0.227%となった。

都銀・信託	証券	地銀
- ~ -	0.226 ~ 0.227	0.225 ~ 0.227

### 翌営業日のマーケット

ビットサイドの資金調達意欲は引き続き旺盛であるため、出合の水準は本日対比横ばい圏を予想する。

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

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想
	10月1日	10月2日	10月2日	10月3日	10月3日
券		▲600	+400	+0	+0
財政		▲28,300	▲51,200	+1,000	+1,000
過不足		▲28,900	▲50,800	+1,000	+1,000
金融調節	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド
共通担保(全店)			▲8,000	+8,000	
国債補充供給	+14,700	▲14,500	+14,500		
当座預金増減		▲28,700	▲36,300	+1,000	+1,000
当座預金残高		5,465,600	5,429,300	5,430,300	5,430,300
準備預金残高		4,941,600			主な需給要因
積み終了先		4,940,700	消費税・法人税・保険		
超過準備		4,940,700	揚げ		
非準備先残高		524,000			
準備預金進捗率		99.9%			
平均		53.3%			
乖離率		46.6%			

### 10月1日のオペ結果

[%][億円] ※米ドル資金供給は百万\$

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
米ドル資金供給(10/3~10/10)						
	1	1	5,070	5,070		
国債補充供給(10/1~10/2)						
	14,720	14,720	▲0.050	▲0.050		
	79	79	▲0.050	▲0.050		
共通担保(全店)(10/2~10/16)						
	8,000	12,183	8,006		65.7	

マネタリーベース [億円]  
9月30日時点 6,734,600

所要	所要
今積期の所要準備額	3,940,700
10月2日以降の残り所要	
積数	3,300
平均	200

### 国庫短期証券入札予定

10月4日	3ヶ月(第1260回)
10月9日	6ヶ月
10月11日	3ヶ月
10月17日	1年
10月3日	10年
10月8日	30年
10月10日	5年
10月22日	10年クワイメント・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	1500	1,500	2	9月4日	1
1年超3年以下	3250	3,500	2 7 11 18	9月25日	4
3年超5年以下	3250	3,750	2 7 18 28	9月25日	4
5年超10年以下	3750	4,000	7 11 18 28	9月25日	4
10年超25年以下	1500	1,500	7 11 28	9月25日	3
25年超	750	750	2 18	9月11日	2
物価連動債	600	600	28	9月25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