



短期市場の推移

	10月2日	10月3日	10月4日	10月7日
加重平均金利	0.227	0.227	0.227	0.227
東京レポレート(TN)	0.230	0.234	0.240	0.233
無コール残	71,329	70,061	74,258	75,090
ON	29,174	26,686	30,993	30,785
その他	42,155	43,375	43,265	44,305
有コール残	41,921	39,175	37,758	41,178

10月9日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
		(米) 9月17~18日のFOMC議事録	

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	0.227	0.227	0.191
T/N	-	-	-	0.188
S/N	-	-	-	-
1W	0.230	0.390	0.271	0.200
2W	-	-	-	0.200
3W	-	-	-	0.200
1M	-	-	0.290	0.201
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	0.209
6M	-	-	-	0.252
1Y	-	-	-	0.317

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0.226%~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)は前営業日対比横ばいの0.227%となった。

都銀・信託	証券	地銀
- ~ -	0.227 ~ 0.227	0.226 ~ 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8日		10月9日		10月10日	
券		+100		+100		▲1,000
財政		▲3,500		▲9,400		+5,000
過不足		▲3,400		▲9,300		+4,000
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		+11,700				
CP等買入	▲200					
社債等買入			▲200			
国債補充供給	+11,100	▲11,100	+11,100			
当座預金増減		+8,100		+1,600		+4,000
当座預金残高		5,411,300		5,412,900		5,416,900
準備預金残高		4,836,400	主な需給要因			
積み終了先		4,836,300	国債発行(30年)		国庫短期証券発行償還	
超過準備		4,836,300	(6M)			
非準備先残高		574,900				
準備預金進捗率		99.9%				
平均		76.7%				
乖離率		23.2%				

10月8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(10/10~10/17)	0	0	5,080	5,080		
国債補充供給(10/8~10/9)	11,408	11,408	▲0.050	▲0.050		
	10	10	▲0.050	▲0.050		

マネタリーベース	所要
10月7日時点 6,643,300	今積期の所要準備額 3,924,400
	10月9日以降の残り所要
	積数 300
	平均 0

国庫短期証券入札予定

10月9日	6ヶ月(第1261回)
10月11日	3ヶ月(第1262回)
10月17日	1年
10月18日	3ヶ月
10月10日	5年
10月22日	10年プライメート・トランジション
10月24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	10月2日	0
1年超3年以下	3250	3,250	2 7 11 18	10月7日	2
3年超5年以下	3250	3,250	2 7 18 28	10月7日	2
5年超10年以下	3750	3,750	7 11 18 28	10月7日	3
10年超25年以下	1500	1,500	7 11 28	10月7日	2
25年超	750	750	2 18	10月2日	1
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