



短期市場の推移

	10月4日	10月7日	10月8日	10月9日
加重平均金利	0.227	0.227	0.227	0.227
東京レポレート(TN)	0.240	0.233	0.188	0.230
無コール残	74,258	75,090	74,417	74,398
ON	30,993	30,785	29,962	29,688
その他	43,265	44,305	44,455	44,710
有コール残	37,758	41,178	41,594	39,835

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	0.228	0.227	0.236
T/N	-	-	-	0.239
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	-	0.201
2W	-	-	0.290	0.200
3W	-	-	-	0.200
1M	-	-	-	0.202
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	0.210
6M	-	-	-	0.252
1Y	-	-	-	0.317

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

10月11日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	(米) ボウマンFRB理事の講演	-
-	-	-	-
-	-	-	-

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。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	10月10日	10月11日	10月11日	10月15日	10月10日	10月15日
券	▲200	▲300	▲300	+1,000		
財政	+3,000	▲21,900	▲21,900	+90,000		
過不足	+2,800	▲22,200	▲22,200	+91,000		
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
CP等買入	▲200		▲300			
社債等買入	▲100					
国債補完供給	+9,300	▲9,600	+9,600			
当座預金増減	+2,200	▲12,900	▲12,900	+91,000		
当座預金残高	5,408,900	5,396,000	5,396,000	5,487,000		
準備預金残高	4,836,000	主な需給要因				
積み終了先	4,835,900	国債発行(5年)		源泉税揚げ		
超過準備	4,835,900			年金定時払い		
非準備先残高	572,900			国庫短期証券発行償還(3M)		
準備預金進捗率	99.9%			国債発行償還(個人)		
平均	83.3%					
乖離率	16.6%					

10月10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(10/10~10/11)	9,876	9,876	▲0.050	▲0.050		
	0	0				

マネタリーベース 【億円】
10月9日時点 6,646,600

所要	【億円】
今積期の所要準備額	3,924,400
10月11日以降の残り所要	
積数	200
平均	0

国庫短期証券入札予定

10月11日	3ヶ月(第1262回)
10月17日	1年(第1263回)
10月18日	3ヶ月
10月25日	3ヶ月
10月22日	10年クライメート・トランザクション
10月24日	20年
10月29日	2年
11月7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	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