



短期市場の推移

	10月7日	10月8日	10月9日	10月10日
加重平均金利	0.227	0.227	0.227	0.227
東京レボレート(TN)	0.233	0.188	0.230	0.239
無コール残	75,090	74,417	74,398	74,846
ON	30,785	29,962	29,688	29,016
その他	44,305	44,455	44,710	45,830
有コール残	41,178	41,594	39,835	40,096

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意。

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	0.221	0.227	0.227	0.248
T/N	-	-	-	0.245
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	0.226	0.201
2W	-	-	0.227	0.202
3W	-	-	-	0.201
1M	-	-	-	0.202
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	0.210
6M	-	-	-	0.252
1Y	-	-	-	0.317

無担保コール(速報)は日銀、東京レボレートは日本証券業協会公表

10月15日の予定 (時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
13:30	8月の鉱工業生産			-	
	-			-	
	-			-	

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11日	10月15日	10月15日	10月16日	10月16日	10月16日
券		▲300		▲200		+0
財政		▲27,400		+89,500		▲6,000
過不足		▲27,700		+89,300		▲6,000
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				+8,500		
共通担保(全店)						▲8,000
CP等買入	▲300		▲200			
国債補充供給	+9,600	▲9,200	+9,200			
当座預金増減		▲27,600		+106,800		▲14,000
当座預金残高		5,381,300		5,488,100		5,474,100
準備預金残高		4,832,500	主な需給要因			
積み終了先		4,832,500	源泉税揚げ		流動性供給	
超過準備		4,832,500	年金定時払い			
非準備先残高		548,800	国庫短期証券発行償還			
準備預金進捗率		100.0%	(3M)			
平均		96.7%	国債発行償還(個人)			
乖離率		3.3%				

10月11日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
国債買入(10/15~)						
1~3年	3,250	10,562	3,254	0.002	0.003	86.4
5~10年	3,750	9,268	3,753	▲0.011	▲0.009	79.9
10~25年	1,500	2,471	1,503	▲0.018	▲0.012	31.8
国債補充供給(10/11~10/15)						
	9,473	9,473	▲0.050	▲0.050		
	0	0				

マネタリーベース

10月10日時点 6,649,000

所要

今積期の所要準備額	10月15日以降の残り所要
3,924,400	積数 0
	平均 0

国庫短期証券入札予定

10月17日	1年(第1263回)
10月18日	3ヶ月(第1264回)
10月25日	3ヶ月
11月1日	3ヶ月
10月22日	10年クライマート・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11日	1
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11日	2
10年超25年以下	1500	1,500	7	11	28		10月11日	1
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