



### 短期市場の推移

	10月8日	10月9日	10月10日	10月11日
加重平均金利	0.227	0.227	0.227	0.227
東京レポレート(TN)	0.188	0.230	0.239	0.245
無コール残	74,417	74,398	74,846	72,059
ON	29,962	29,688	29,016	26,769
その他	44,455	44,710	45,830	45,290
有コール残	41,594	39,835	40,096	40,042

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	0.236
T/N	-	-	-	0.240
S/N	-	-	-	-
1W	0.230	0.390	0.271	0.202
2W	-	-	0.300	0.201
3W	-	-	-	0.201
1M	-	-	-	0.202
2M	-	-	-	-
3M	-	-	0.310	0.209
6M	-	-	-	0.254
1Y	-	-	-	0.318

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16日の予定 (時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
10:30	安達日銀審議委員のあいさつ (香川県)			
17:00	業態別の日銀当座預金残高 (9月)			
	市場調節に関する意見交換会			

### 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。ビッド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

ビッド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15日	10月16日	10月16日	10月17日	10月17日	10月17日
券	▲200		+700		▲1,000	
財政	+87,200		▲6,400		+1,000	
過不足		+87,000		▲5,700		+0
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	+8,000		
CP等買入	▲200					
社債等買入			▲200			
国債補充供給	+9,200	▲9,700	+9,700			
当座預金増減		+94,800		+3,800		+0
当座預金残高		5,476,100		5,479,900		5,479,900
準備預金残高		4,910,200				主な需給要因
積み終了先		4,910,200				流動性供給
超過準備		4,910,200				
非準備先残高		565,900				
準備預金進捗率		100.0%				
平均		100.0%				
乖離率		0.0%				

### 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
米ドル資金供給(10/17~10/24)	0	0	5,080	5,080		
国債補充供給(10/15~10/16)	9,943	9,943	▲0.050	▲0.050		
共通担保(全店)(10/16~10/30)	8,000	11,972	8,006		66.9	

マネタリーベース [億円]  
10月11日時点 6,621,700

所要	[億円]
来積期の所要準備額	4,041,000
10月16日以降の残り所要	
積数	4,041,000
平均	130,400

### 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

### 国債入札予定

10月22日	10年クライメート・トランジション
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		0
1年超3年以下	3250	3,250	2	7 11 18	10月2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