



短期市場の推移

	10月10日	10月14日	10月15日	10月16日
加重平均金利	0.477	0.477	0.477	0.477
東京レボレート(TN)	0.498	0.498	0.498	0.497
無コール残	80,152	78,189	80,027	81,670
ON	28,624	27,187	27,115	28,118
その他	51,528	51,002	52,912	53,552
有コール残	26,967	26,770	26,441	26,618

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	0.450	0.478	0.477	0.497
T/N	-	-	-	0.499
S/N	-	-	-	-
1W	0.478	0.560	0.488	0.490
2W	-	-	-	0.489
3W	-	-	0.475	0.489
1M	-	-	-	0.496
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	0.548
6M	-	-	-	0.612
1Y	-	-	-	0.718

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

資金需給

[億円]

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	10月17日	10月20日	10月20日	10月21日	10月21日	10月21日
券		▲200		▲600		+0
財政		+3,900		▲6,100		▲4,000
過不足		+3,700		▲6,700		▲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		+9,500				
国債補充供給	+1,600	▲1,400	+1,400			
当座預金増減		+13,400		▲5,300		▲4,000
当座預金残高		4,974,100		4,974,800		4,970,800
準備預金残高		4,523,600				
積み終了先		4,498,400				
超過準備		4,292,000				
非準備先残高		450,500				
準備預金進捗率		99.3%				
平均		12.9%				
乖離率		86.4%				

10月17日のオペ結果

オペ種類 オファー 応札 落札 足切 平均 按分

国債補充供給(10/17~10/20)

1,539	1,539	0.250	0.250
0	0	0.250	0.250

マネタリーベース [億円]

10月16日時点 6,172,600

所要

今積期の所要準備額 4,104,100

10月20日以降の残り所要

積数 30,200

平均 1,100

国庫短期証券入札予定

10月24日	3ヶ月(第1340回)
10月31日	3ヶ月
11月6日	6ヶ月
11月7日	3ヶ月

国債入札予定

10月21日	10年クワイメート・トランジション
10月31日	2年
11月5日	10年
11月11日	30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	1000	1,000	8	10月8日	0
1年超3年以下	3000	3,000	8 16 22	10月8日	2
3年超5年以下	2800	3,250	16 22 28	9月29日	3
5年超10年以下	3050	3,050	8 16 28	10月8日	2
10年超25年以下	1150	1,150	8 22 28	10月8日	2
25年超	750	750	16 28	9月29日	2
物価連動債	500	500	28	9月29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