



短期市場の推移

[億円] [%]

	10月15日	10月16日	10月17日	10月20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	0.497	0.499	0.499
無コール残	80,027	81,670	80,517	83,013
ON	27,115	28,118	26,780	29,106
その他	52,912	53,552	53,737	53,907
有コール残	26,441	26,618	26,992	26,976

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重。

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	0.525	0.477	0.497
T/N	-	-	-	0.497
S/N	-	-	-	-
1W	0.485	0.510	0.492	0.491
2W	0.470	0.481	0.476	0.493
3W	-	-	-	0.492
1M	-	-	-	0.497
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	0.562
6M	-	-	-	0.618
1Y	-	-	-	0.726

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21日	10月22日	10月22日	10月23日	10月23日	10月23日
券		▲100	▲200			+0
財政		▲3,700	▲2,000			+3,000
過不足		▲3,800	▲2,200			+3,000
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			▲300			
社債等買入	▲100					
国債補完供給	+2,000	▲1,300	+1,300			
当座預金増減		▲3,200	▲1,200			+3,000
当座預金残高		4,962,700	4,961,500			4,964,500
準備預金残高		4,505,600				主な需給要因
積み終了先		4,503,000	国債発行 (GX10年)			
超過準備		4,500,900				
非準備先残高		457,100				
準備預金進捗率		99.7%				
平均		19.4%				
乖離率		80.3%				

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31日	2年
11月5日	10年
11月11日	30年
11月13日	5年

今月の国債買入オペ予定

オペ種類	一回当たりオペ金額	直近オペ金額	オペ予定日	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 -

10月22日の予定 (時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
8:50	貿易収支 (9月)			(欧) ラガルドECB総裁の講演	
	-			-	
	-			-	

本日の市況

無担保コールON物は0.477%の出合から始まり、その後も同程度で推移した。ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比横ばいの0.477%となった。

[%]

都銀・信託	証券	地銀
- ~ -	0.477 ~ 0.477	0.477 ~ 0.477

翌営業日のマーケット

出合いの水準は本日対比横ばい圏を予想する。

[%][億円]※米ドル資金供給は百万\$

10月21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(10/23~10/30)

0 0 4.370 4.370

国債補完供給(10/21~10/22)

1,337 1,337 0.250 0.250

40 40 0.250 0.250

マネタリーベース [億円]

10月20日時点 6,178,600

所要

[億円]

今積期の所要準備額 4,104,100

10月22日以降の残り所要

積数 13,000

平均 500

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