



短期市場の推移

[億円] [%]

	10月16日	10月17日	10月20日	10月21日
加重平均金利	0.477	0.477	0.477	0.477
東京レボレート(TN)	0.497	0.499	0.499	0.497
無コール残	81,670	80,517	83,013	83,741
ON	28,118	26,780	29,106	29,089
その他	53,552	53,737	53,907	54,652
有コール残	26,618	26,992	26,976	26,807

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	0.530	0.477	0.496
T/N	-	-	-	0.495
S/N	-	-	-	-
1W	0.484	0.610	0.537	0.491
2W	0.472	0.550	0.493	0.492
3W	-	-	-	0.492
1M	-	-	-	0.496
2M	-	-	-	-
3M	-	-	0.620	0.557
6M	-	-	-	0.618
1Y	-	-	-	0.728

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22日	10月23日	10月23日	10月24日	10月24日	10月24日
券						
財政						
過不足						
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						
CP等買入	▲300					
国債補完供給	+1,300	▲1,000	+1,000			
当座預金増減		+2,700	+14,300			▲5,000
当座預金残高		4,965,400	4,961,500			4,956,500
準備預金残高		4,519,300				
積み終了先		4,516,800				
超過準備		4,516,800				
非準備先残高		446,100				
準備預金進捗率		99.7%				
平均		22.6%				
乖離率		77.2%				

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
1年超3年以下	3000	3,000	8 16 22		10月22日
3年超5年以下	2800	2,800	16 22 28		10月22日
5年超10年以下	3050	3,050	8 16 28		10月16日
10年超25年以下	1150	1,150	8 22 28		10月22日
25年超	750	750	16 28		10月16日
物価連動債	500	500	28		9月29日
変動利付債	-	300	-		4月14日

10月23日の予定(時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-		(欧) 消費者信頼感指数(10月)	
-		(米) 中古住宅販売件数(9月)	
-		-	

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22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(10/23~)

1~3年	3,000	4,563	3,004	▲0.004	▲0.002	75.9
3~5年	2,800	5,756	2,803	▲0.005	▲0.002	4.7
10~25年	1,150	3,771	1,153	▲0.015	▲0.013	63.8

国債補完供給(10/22~10/23)

1,132	1,132	0.250	0.250
0	0		

マネタリーベース [億円]

10月21日時点 6,175,500

所要

[億円]

今積期の所要準備額	4,104,100
10月23日以降の残り所要	
積数	10,500
平均	400

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