



短期市場の推移

	10月20日	10月21日	10月22日	10月23日
加重平均金利	0.477	0.477	0.477	0.477
東京レボレート(TN)	0.499	0.497	0.495	0.495
無コール残	83,013	83,741	81,031	81,330
ON	29,106	29,089	28,329	27,987
その他	53,907	54,652	52,702	53,343
有コール残	26,976	26,807	26,664	26,854

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	0.445	0.478	0.477	0.498
T/N	-	-	-	0.498
S/N	-	-	-	-
1W	0.519	0.530	0.522	0.491
2W	-	-	-	0.492
3W	-	-	-	0.491
1M	0.640	0.650	0.643	0.496
2M	-	-	-	-
3M	-	-	0.700	0.559
6M	-	-	-	0.626
1Y	-	-	-	0.730

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27日の予定(時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
	-		(米) 耐久財受注(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。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	10月24日		10月27日		10月28日	
券	▲800		+100		+0	
財政	+8,400		+1,200		▲6,000	
過不足	+7,600		+1,300		▲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
CP等買入	▲400		▲1,000			
社債等買入	▲900		▲200			
国債補完供給	+1,000	▲900	+900			
当座預金増減	+6,400		+1,000		▲6,000	
当座預金残高	4,983,100		4,982,200		4,976,200	
準備預金残高	4,536,600		主な需給要因			
積み終了先	4,534,900		国庫短期証券発行償還(3M)			
超過準備	4,534,900					
非準備先残高	446,500					
準備預金進捗率	99.9%					
平均	35.5%					
乖離率	64.4%					

10月24日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
国債補完供給(10/24~10/27)						
	923	923	0.250	0.250		
	0	0				

マネタリーベース [億円]

10月23日時点 6,190,500

所要

今積期の所要準備額	4,104,100
10月27日以降の残り所要	
積数	3,300
平均	200

国庫短期証券入札予定

10月31日	3ヶ月(第1341回)
11月6日	6ヶ月
11月7日	3ヶ月
11月14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

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