



短期市場の推移

[億円] [%]

	10月21日	10月22日	10月23日	10月24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	0.495	0.495	0.498
無コール残	83,741	81,031	81,330	80,689
ON	29,089	28,329	27,987	27,096
その他	54,652	52,702	53,343	53,593
有コール残	26,807	26,664	26,854	26,703

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	-	-	-	0.499
S/N	-	-	-	-
1W	0.550	0.560	0.552	0.491
2W	0.471	0.481	0.476	0.491
3W	-	-	-	0.491
1M	-	-	-	0.495
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	0.562
6M	-	-	-	0.626
1Y	-	-	-	0.732

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27日		10月28日		10月29日	
券	+0		+0		+0	
財政	▲3,400		▲1,200		▲3,000	
過不足	▲3,400		▲1,200		▲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
共通担保(全店)					▲8,000	
CP等買入	▲1,000					
社債等買入	▲200					
国債補完供給	+900		+1,400			
当座預金増減	▲5,100		+200		▲11,000	
当座預金残高	4,978,000		4,978,200		4,967,200	
準備預金残高	4,535,200				主な需給要因	
積み終了先	4,533,900					
超過準備	4,533,800					
非準備先残高	442,800					
準備預金進捗率	99.9%					
平均	38.7%					
乖離率	61.2%					

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	0
1年超3年以下	3000	3,000	8	16	22			10月22日	0
3年超5年以下	2800	2,800	16	22	28			10月22日	1
5年超10年以下	3050	3,050	8	16	28			10月16日	1
10年超25年以下	1150	1,150	8	22	28			10月22日	1
25年超	750	750	16	28				10月16日	1
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(登録)第243号 加入協会 日本証券業協会

10月28日の予定(時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
14:00	基礎的なインフレ率を捕捉するための指標(9月)			(米) FOMC(1日目)	
	日米首脳会談			-	
	-			-	

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27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(10/27~10/28)						
	1,365	1,365	0.250	0.250		
	100	100	0.250	0.250		

マネタリーベース [億円]

10月24日時点 6,197,600

所要

[億円]

今積期の所要準備額	4,104,100
10月28日以降の残り所要	
積数	2,000
平均	100