



短期市場の推移

[億円] [%]

	10月27日	10月28日	10月29日	10月30日
加重平均金利	0.477	0.477	0.477	0.476
東京レボ レート(TN)	0.499	0.496	0.495	0.481
無コール残	80,833	79,098	76,334	76,093
ON	27,240	26,085	26,651	26,840
その他	53,593	53,013	49,683	49,253
有コール残	26,778	27,485	27,921	27,316

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。無担保コール残高は無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	0.493
T/N	-	-	-	0.497
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	-	0.491
2W	0.471	0.600	0.518	0.491
3W	-	-	0.535	0.491
1M	0.530	0.600	0.556	0.493
2M	-	-	0.575	-
3M	-	-	-	0.566
6M	-	-	-	0.629
1Y	-	-	-	0.737

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31日		11月4日		11月5日	
券		+100		▲300		+1,000	
財政		▲11,400		▲27,900		▲10,000	
過不足		▲11,300		▲28,200		▲9,000	
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
社債等買入		▲100					
国債補完供給		+900		▲1,600		+1,600	

国庫短期証券入札予定

11月6日	6ヶ月(第1342回)
11月7日	3ヶ月(第1343回)
11月14日	3ヶ月
11月19日	1年
国債入札予定	
11月5日	10年
11月11日	30年
11月13日	5年
11月17日	物価連動

来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	6	10月8日	1
1年超3年以下	3000	3,000	6 12 20	10月22日	3
3年超5年以下	2800	2,800	6 20 27	10月22日	3
5年超10年以下	3050	3,050	12 20 27	10月16日	3
10年超25年以下	1150	1,150	6 12 27	10月22日	3
25年超	750	750	6 20	10月16日	2
物価連動債	500	500	27	10月28日	1
変動利付債	-	300	-	4月14日	-

11月4日の予定 (時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
13:00	日銀当座預金増減要因と 金融調節 (10月実績)		(米) 貿易収支 (9月)		
	-		(米) ポウマンFRB副議長 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+0.001%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31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(10/31~11/4)	1,644	1,644	0.250	0.250		
	0	0				

マネタリーベース [億円]

10月30日時点 6,204,100

所要

今積期の所要準備額		3,983,200
11月4日以降の残り所要		
積数	100	
平均	0	

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