



短期市場の推移

[億円] [%]

	10月7日	10月8日	10月9日	10月13日
加重平均金利	1.227	1.228	1.227	1.228
東京レボレート(TN)	1.250	1.250	1.251	1.250
無コール残	117,489	117,117	115,507	115,689
ON	52,215	49,383	48,068	47,425
その他	65,274	67,734	67,439	68,264
有コール残	22,996	23,333	22,857	23,060

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	1.200	1.280	1.228	1.250
T/N	-	-	-	1.250
S/N	-	-	-	-
1W	1.225	1.235	1.226	1.250
2W	1.229	1.232	1.231	1.250
3W	-	-	-	1.250
1M	1.320	1.430	1.373	1.254
2M	-	-	-	-
3M	1.500	1.510	1.505	1.316
6M	-	-	-	1.443
1Y	-	-	-	1.644

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14日	10月15日	10月16日
券	+700	▲100	+0
財政	▲3,800	+62,600	▲2,000
過不足	▲3,100	+62,500	▲2,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
社債等買入	▲100		
共通担保(全店)	▲8,000	+8,000	
国債補完供給	+100	▲100	+100
当座預金増減	▲3,200	+62,600	▲2,000
当座預金残高	4,095,100	4,157,700	4,155,700
準備預金残高	3,784,100		
積み終了先	3,784,100		
超過準備	3,784,100		
非準備先残高	311,000		
準備預金進捗率	100.0%		
平均	96.7%		
乖離率	3.3%		

10月14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(10/14~10/15)	60	60	0.800	0.800		
	0	0				

マネタリーベース [億円]

10月13日時点 5,284,400

所要

今積期の所要準備額	4,032,500
10月15日以降の残り所要	
積数	0
平均	0

国庫短期証券入札予定

10月16日	3ヶ月(第1413回)
10月19日	1年(第1414回)
10月23日	3ヶ月
10月29日	3ヶ月

国債入札予定

10月20日	20年
10月29日	2年
11月2日	5年(クライマート・トランジション)
11月5日	10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	1,000	1,000	7		10月7日 0
1年超3年以下	3,300	3,300	7 21		10月7日 1
3年超5年以下	2,900	3,200	16 28		9月16日 2
5年超10年以下	3,050	3,350	21 28		9月16日 2
10年超25年以下	850	850	7 16		10月7日 1
25年超	750	750	16 21		9月16日 2
物価連動債	300	300	28		9月28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(登金)第243号 加入協会 日本証券業協会