



短期市場の推移

[億円] [%]

	10月13日	10月14日	10月15日	10月16日
加重平均金利	1.228	1.228	1.228	1.227
東京レボレート(TN)	1.250	1.250	1.250	1.250
無コール残	115,689	112,512	111,662	107,455
ON	47,425	44,258	43,468	39,991
その他	68,264	68,254	68,194	67,464
有コール残	23,060	22,677	22,498	22,777

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総額。

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	1.201	1.250	1.227	1.250
T/N	-	-	-	1.250
S/N	-	-	-	-
1W	1.225	1.231	1.226	1.250
2W	-	-	-	1.250
3W	-	-	-	1.250
1M	-	-	-	1.254
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	1.322
6M	-	-	-	1.441
1Y	-	-	-	1.646

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19日	10月20日	10月20日	10月21日	10月21日	10月21日
券		+100	▲100		+0	
財政		+11,600	+16,400		▲7,000	
過不足		+11,700	+16,300		▲7,000	
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
国債買入		+3,700				
国債補完供給	+300	▲300	+300			
当座預金増減		+15,400	+16,600		▲7,000	
当座預金残高		4,173,400	4,190,000		4,183,000	
準備預金残高		3,870,500				
積み終了先		3,843,400	国庫短期証券発行償還	国債発行(20年)		
超過準備		3,838,000	(1Y)			
非準備先残高		302,900				
準備預金進捗率		97.8%				
平均		12.9%				
乖離率		84.9%				

国庫短期証券入札予定

10月23日	3ヶ月(第1415回)
10月29日	3ヶ月
11月6日	3ヶ月
11月9日	6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年クライメート・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	2,900	16	28				10月16日	1
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16日	0
25年超	750	750	16	21				10月16日	1
物価連動債	300	300	28					9月28日	1
変動利付債	-	300						4月14日	-

10月20日の予定(時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
	-		(米) 住宅着工件数(9月)		
	-		-		
	-		-		

本日の市況

無担保コールON物は1.227%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1.227%となった。

都銀・信託		証券	地銀
- ~ -		1.227 ~ 1.227	1.227 ~ 1.227

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19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(10/19~10/20)	356	356	0.800	0.800		
	0	0				

マネタリーベース [億円]

10月16日時点 5,343,100

所要

今積期の所要準備額		4,163,000
10月20日以降の残り所要	積数	91,800
	平均	3,400

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