



短期市場の推移

[億円] [%]

	10月14日	10月15日	10月16日	10月19日
加重平均金利	1.228	1.228	1.227	1.227
東京レポレート(TN)	1.250	1.250	1.250	1.250
無コール残	112,512	111,662	107,455	104,591
ON	44,258	43,468	39,991	35,307
その他	68,254	68,194	67,464	69,284
有コール残	22,677	22,498	22,777	23,964

加重平均金利・コール残高は日銀、東京レポ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)			レポ市場
	最低	最高	平均	東京レポレート
O/N	1.201	1.280	1.228	1.250
T/N	-	-	1.215	1.250
S/N	-	-	-	-
1W	1.225	1.310	1.232	1.250
2W	1.228	1.290	1.230	1.250
3W	-	-	-	1.250
1M	-	-	-	1.255
2M	-	-	-	-
3M	1.510	1.520	1.513	1.325
6M	-	-	-	1.442
1Y	-	-	-	1.646

無担保コール(速報)は日銀、東京レポ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20日	10月21日	10月21日	10月22日	10月22日	10月22日
券		▲100	▲400			+0
財政		+10,800	▲13,100			▲5,000
過不足		+10,700	▲13,500			▲5,000
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
国債補完供給	+300	▲400	+400			
社債等買入			▲200			
当座預金増減		+10,600	▲13,300			▲5,000
当座預金残高		4,184,000	4,170,700			4,165,700
準備預金残高		3,865,500				主な需給要因
積み終了先		3,843,000				国債発行(20年)
超過準備		3,841,800				
非準備先残高		318,500				
準備預金進捗率		98.4%				
平均		16.1%				
乖離率		82.2%				

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
11月10日	30年

今月の国債買入オペ予定

オペ種類	一回当たりオペファー金額	直近オペファー額	オペファー予定日					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21日の予定(時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
8:50	貿易収支(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+0.001%の1.228%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20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(10/20~10/21)

382	382	0.800	0.800
0	0		

米ドル資金供給用担保国債供給(10/21~10/30)

5,000	2	2	1.220	1.220
-------	---	---	-------	-------

米ドル資金供給(10/22~10/29)

2	2	4.130
---	---	-------

マネタリーベース [億円]

10月19日時点	5,358,400
----------	-----------

所要

今積期の所要準備額	4,163,000
-----------	-----------

10月21日以降の残り所要	
---------------	--

積数	68,100
----	--------

平均	2,600
----	-------

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