



短期市場の推移

[億円] [%]

	10月15日	10月16日	10月19日	10月20日
加重平均金利	1.228	1.227	1.227	1.228
東京レポレート(TN)	1.250	1.250	1.250	1.250
無コール残	111,662	107,455	104,591	105,691
ON	43,468	39,991	35,307	36,777
その他	68,194	67,464	69,284	68,914
有コール残	22,498	22,777	23,964	24,172

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、無担保コール残高は無担保コール残高の値

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	1.227	1.250
T/N	-	-	-	1.250
S/N	-	-	-	-
1W	1.226	1.250	1.228	1.250
2W	1.310	1.330	1.320	1.251
3W	-	-	-	1.251
1M	-	-	-	1.254
2M	-	-	-	-
3M	1.500	1.550	1.512	1.329
6M	-	-	-	1.443
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21日	10月22日	10月22日	10月23日	10月23日	10月23日
券		▲400		▲600		▲500
財政		▲12,900		+12,900		▲5,000
過不足		▲13,300		+12,300		▲5,500
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				+6,800		
社債等買入	▲200					
国債補完供給	+400	▲100	+100			
当座預金増減		▲13,200		+19,200		▲5,500
当座預金残高		4,170,800		4,190,000		4,184,500
準備預金残高		3,857,600				
積み終了先		3,838,800				
超過準備		3,836,800				
非準備先残高		313,200				
準備預金進捗率		97.8%				
平均		19.4%				
乖離率		78.4%				

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年クワイメート・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
			7	21	28	28	28		
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21日	0
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	3,050	21	28				10月21日	1
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21日	0
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

10月22日の予定(時刻は日本時間)

時刻	日本		海外	
	日本	予想	海外	予想
17:00	日銀が保有する国債の銘柄別残高		(米) 景気先行指数(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▲0.001%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21日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
国債買入(10/22~)						
1~3年	3,300	8,073	3,304	0.002	0.003	79.0
5~10年	3,050	5,907	3,059	0.000	0.002	46.0
25年~	750	2,023	754	▲0.010	▲0.007	45.3
国債補完供給(10/21~10/22)						
	112	112	0.800	0.800		
	0	0				

マネタリーベース [億円]

10月20日時点 5,369,100

所要

今積期の所要準備額 4,163,000

10月22日以降の残り所要

積数 47,300

平均 1,900