



短期市場の推移

[億円] [%]

	10月22日	10月23日	10月26日	10月27日
加重平均金利	1.227	1.227	1.227	1.227
東京レボレート(TN)	1.250	1.250	1.250	1.250
無コール残	104,063	101,592	101,588	101,633
ON	35,534	32,893	33,739	33,489
その他	68,529	68,699	67,849	68,144
有コール残	22,837	22,307	22,686	23,103

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	1.203	1.275	1.227	1.250
T/N	-	-	1.220	1.250
S/N	-	-	-	-
1W	1.231	1.340	1.271	1.250
2W	-	-	1.310	1.250
3W	-	-	-	1.250
1M	-	-	1.340	1.253
2M	-	-	-	-
3M	1.520	1.570	1.541	1.336
6M	-	-	-	1.444
1Y	-	-	-	1.647

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28日	10月29日	10月30日
券	▲100	▲500	▲400
財政	▲2,100	+8,100	▲2,700
過不足	▲2,200	+7,600	▲3,100
金融調節	エンド	スタート	エンド
国債補完供給	+400	+300	▲100
共通担保(全店)	▲8,000	+8,000	
社債等買入	▲100		+6,000
国債買入			
当座預金増減	▲2,200	+13,800	▲3,100
当座預金残高	4,180,500	4,194,300	4,191,200
準備預金残高	3,863,200	主な需給要因	
積み終了先	3,863,100		
超過準備	3,863,100		
非準備先残高	317,300		
準備預金進捗率	99.9%		
平均	41.9%		
乖離率	58.0%		

国庫短期証券入札予定

10月29日	3ヶ月(第1416回)
11月6日	3ヶ月
11月9日	6ヶ月
11月13日	3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21日	0
3年超5年以下	2,900	2,900	16	28				10月28日	0
5年超10年以下	3,050	3,050	21	28				10月28日	0
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					10月28日	0
変動利付債	-	300						4月14日	-

10月29日の予定(時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
日銀金融政策決定会合(1日目)		(米) PCE (9月)	
-		(米) GDP (3Q)	
-		(欧) ECB理事会	

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28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(10/29~)						
3~5年	2,900	6,666	2,908	0.031	0.033	44.9
5~10年	3,050	6,161	3,052	0.038	0.041	82.9
物価連動	300	1,536	300	▲0.560	▲0.590	63.2
国債補完供給(10/28~10/29)						
	331	331	0.800	0.800		
	0	0				

マネタリーベース [億円]

10月27日時点 5,369,800

所要

[億円]

今積期の所要準備額	4,163,000
10月29日以降の残り所要	
積数	700
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