



短期市場の推移

[億円] [%]

	10月26日	10月27日	10月28日	10月29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	101,588	101,633	101,398	102,180
ON	33,739	33,489	33,424	33,386
その他	67,849	68,144	67,974	68,794
有コール残	22,686	23,103	21,795	21,766

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	1.227	1.250
T/N	-	-	-	1.250
S/N	-	-	-	-
1W	1.225	1.360	1.248	1.250
2W	1.280	1.350	1.327	1.250
3W	1.300	1.320	1.316	1.250
1M	1.260	1.360	1.334	1.253
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	1.344
6M	-	-	-	1.446
1Y	-	-	-	1.649

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30日	11月2日	11月4日
券	+200	▲700	+0
財政	▲5,200	▲8,100	+41,500
過不足	▲5,000	▲8,800	+41,500
金融調節	エンド	エンド	エンド
国債補完供給 社債等買入	+400	▲100	
当座預金増減	▲4,600	▲8,900	+41,500
当座預金残高	4,185,100	4,176,200	4,217,700
準備預金残高	3,848,300	主な需給要因	
積み終了先	3,848,200	国債発行償還(2年)	国債発行(GX5年)
超過準備	3,848,200	国庫短期証券発行償還(3M)	普通交付税交付金
非準備先残高	336,800		
準備預金進捗率	99.9%		
平均	54.8%		
乖離率	45.1%		

国庫短期証券入札予定

11月6日	3ヶ月(第1417回)
11月9日	6ヶ月
11月13日	3ヶ月
11月18日	1年

国債入札予定

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
11月10日	30年
11月12日	5年

来月の国債買入オペ予定

オペ種類	一回当たりオペ金額	直近オペ金額	オペ予定日	直近日	残り回数
1年以下	1,000	1,000	4	10月7日	1
1年超3年以下	3,300	3,300	4 11	10月21日	2
3年超5年以下	2,900	2,900	19 26	10月28日	2
5年超10年以下	3,050	3,050	11 19	10月28日	2
10年超25年以下	850	850	11 26	10月16日	2
25年超	750	750	4 19	10月21日	2
物価連動債	300	300	26	10月28日	1
変動利付債	-	300	-	4月14日	-

11月2日の予定(時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
14:00	経済・物価情勢の展望			-	
				-	
				-	

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。

日銀は金融政策決定会合において、次回会合までの金融市場調節方針として、無担保コールレート(ON物)を1.250%程度で推移するように促すと決定した。

[%]

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30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(10/30~11/2)

59	59	0.800	0.800
0	0		

マネタリーベース [億円]

10月29日時点 5,377,500

所要

[億円]

今積期の所要準備額	4,163,000
11月2日以降の残り所要	
積数	300
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