



短期市場の推移

	10月11日	10月15日	10月16日	10月17日
加重平均金利	0.227	0.227	0.227	0.227
東京レボレート(TN)	0.245	0.240	0.239	0.235
無コール残	72,059	74,369	70,714	72,124
ON	26,769	28,889	25,134	25,534
その他	45,290	45,480	45,580	46,590
有コール残	40,042	39,509	39,161	38,474

10月21日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
		(米) 景気先行指数 (9月)	

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意。

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	0.221	0.227	0.227	0.232
T/N	-	-	-	0.239
S/N	-	-	-	-
1W	0.230	0.269	0.262	0.201
2W	-	-	0.280	0.201
3W	-	-	-	0.201
1M	-	-	-	0.202
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	0.209
6M	-	-	-	0.257
1Y	-	-	-	0.321

本日の市況

無担保コールON物は0.227%の出合から始まり、その後は主に0.226%~0.227%を中心に取引された。ビットサイドの資金調達意欲は引き続き底堅く、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比横ばいの0.227%となった。

都銀・信託	証券	地銀
- ~ -	0.227 ~ 0.227	0.226 ~ 0.227

翌営業日のマーケット

ビットサイドの資金調達意欲は引き続き旺盛であるため、出合の水準は本日対比横ばい圏を予想する。

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

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想
	10月18日	10月21日	10月21日	10月22日	10月22日
券		▲200	▲400		+0
財政		+2,900	+15,500		+3,000
過不足		+2,700	+15,100		+3,000
金融調節	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド
国債買入				+11,100	
CP等買入	▲100		▲200		
社債等買入	▲100		▲100		
国債補充供給	+8,600	▲8,500	+8,500		
当座預金増減		+2,600	+34,400		+3,000
当座預金残高		5,477,100	5,511,500		5,514,500
準備預金残高		4,903,700			主な需給要因
積み終了先		4,898,900			国庫短期証券発行償還
超過準備		4,879,700			(3M・1Y)
非準備先残高		573,400			
準備預金進捗率		99.5%			
平均		16.1%			
乖離率		83.3%			

10月18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(10/21~)						
1~3年	3,250	7,649	3,256	0.008	0.009	77.2
3~5年	3,250	10,150	3,257	0.012	0.014	15.3
5~10年	3,750	8,607	3,758	0.013	0.016	86.9
25年~	750	1,607	752	0.004	0.010	37.8
社債等買入(10/23~)						
500	1,208	500	0.666	0.693	10.0	
国債補充供給(10/18~10/21)						
8,730	8,730	▲0.050	▲0.050			
0	0					

マナタリベース (億円)  
10月17日時点 6,714,700

所要	所要
今積期の所要準備額	4,041,000
10月21日以降の残り所要	
積数	21,200
平均	800

国庫短期証券入札予定

10月25日	3ヶ月(第1265回)
11月1日	3ヶ月
11月7日	6ヶ月
11月8日	3ヶ月
10月22日	10年クライマート・トランザクション
10月24日	20年
10月29日	2年
11月7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	1500	1,500	2	10月2日	0
1年超3年以下	3250	3,250	2 7 11 18	10月18日	0
3年超5年以下	3250	3,250	2 7 18 28	10月18日	1
5年超10年以下	3750	3,750	7 11 18 28	10月18日	1
10年超25年以下	1500	1,500	7 11 28	10月11日	1
25年超	750	750	2 18	10月18日	0
物価連動債	600	600	28	9月25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