



### 短期市場の推移

	10月22日	10月23日	10月24日	10月25日
加重平均金利	0.227	0.227	0.227	0.227
東京レボレート(TN)	0.232	0.235	0.230	0.239
無コール残	73,067	73,026	73,201	75,127
ON	25,977	25,776	25,801	27,052
その他	47,090	47,250	47,400	48,075
有コール残	38,440	37,693	38,230	37,317

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	0.220	0.275	0.228	0.240
T/N	-	-	-	0.236
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	-	0.204
2W	-	-	0.227	0.203
3W	-	-	-	0.203
1M	-	-	-	0.206
2M	-	-	-	-
3M	0.320	0.330	0.325	0.213
6M	-	-	-	0.278
1Y	-	-	-	0.330

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

### 10月29日の予定 (時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
8:30	9月の完全失業率		(米)	10月の消費者信頼感指数	
8:30	9月の有効求人倍率		-		
	-		-		

### 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。一部金融機関による試し取りに加え、ビッド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+0.001%の0.228%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

ビッド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。

### 資金需給

	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		+0	+0
財政		+1,800		▲4,600	+1,000
過不足		+1,700		▲4,600	+1,000
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				+8,900	
共通担保(全店)					▲8,000
CP等買入	▲700		▲200		
社債等買入	▲600				
国債補充供給	+6,700	▲6,600	+6,600		
当座預金増減		+500	+10,700		▲7,000
当座預金残高		5,488,000	5,498,700		5,491,700
準備預金残高		4,922,300		主な需給要因	
積み終了先		4,921,400			
超過準備		4,921,200			
非準備先残高		565,700			
準備預金進捗率		99.8%			
平均		41.9%			
乖離率		57.9%			

### 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	3,250	9,781	3,254	0.004	0.005	55.4
5~10年	3,750	8,900	3,757	0.015	0.017	15.0
10~25年	1,500	3,498	1,504	0.027	0.030	78.7
物価連動	600	1,870	600	▲0.160	▲0.217	86.7
国債補充供給(10/28~10/29)						
	6,714	6,714	▲0.050	▲0.050		
	50	50	▲0.050	▲0.050		

マナタリーベース [億円]  
10月25日時点 6,730,200

所要		所要
今積期の所要準備額	4,041,000	
10月29日以降の残り所要		
積数	6,100	
平均	300	

### 国庫短期証券入札予定

11月1日	3ヶ月(第1266回)
11月7日	6ヶ月
11月8日	3ヶ月
11月15日	3ヶ月
10月29日	2年
11月7日	10年
11月11日	物価連動
11月13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	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28日	0
5年超10年以下	3750	3,750	7	11	18	28	10月28日	0
10年超25年以下	1500	1,500	7	11	28		10月28日	0
25年超	750	750	2	18			10月28日	0
物価連動債	600	600	28				10月28日	0
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