



短期市場の推移

	10月19日	10月20日	10月21日	10月22日
加重平均金利	▲0.038	▲0.036	▲0.031	▲0.028
東京レポレート(TN)	▲0.097	▲0.101	▲0.101	▲0.096
無コール残	165,509	171,660	178,692	173,937
ON	88,991	92,332	97,804	92,059
その他	76,518	79,328	80,888	81,878
有コール残	17,502	17,203	17,075	19,050

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)			レポ市場
	最低	最高	平均	東京レポレート
O/N	▲0.070	0.001	▲0.027	▲0.095
T/N	-	-	▲0.033	▲0.095
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	▲0.001	▲0.099
2W	▲0.015	▲0.001	▲0.007	▲0.099
3W	-	-	-	▲0.102
1M	-	-	▲0.015	▲0.107
2M	-	-	-	-
3M	-	-	0.180	▲0.113
6M	-	-	-	▲0.120
1Y	-	-	-	▲0.130

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

10月26日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	23:00 (米)10月消費者信頼感指数	110.0
-	-	-	-
-	-	-	-

経済指標及び予想値は株式会社フィスコ提供

本日の市況

本日の無担保コールON物は▲0.040%の出合から始まり、その後は主に▲0.065%~▲0.010%の水準で出合が見られた。先週に引き続き、堅調な地合いとなり、同加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.001%の▲0.027%となった。

都銀・信託	証券	地銀
- ~ -	- ~ -	▲0.055 ~ ▲0.010

翌営業日のマーケット

引き続き地銀を中心に調達ニーズが強く、堅調な地合で推移すると予想。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	10月25日	10月26日	10月26日	10月27日	10月27日	10月28日
券	▲700	▲600	▲600	▲600	▲600	+0
財政	+5,800	▲2,400	▲2,400	+3,000	+3,000	+3,000
過不足	+5,100	▲3,000	▲3,000	+3,000	+3,000	+3,000
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
共通担保(全店)					▲2,400	
CP等買入	▲200		▲700			
社債等買入	▲300	+800				
国債補完供給	+200	▲200	+200			
当座預金増減	+5,400		▲3,500		+600	
当座預金残高	5,408,500		5,405,000		5,405,600	
準備預金残高	4,758,300					
積み終了先	4,757,900					
超過準備	4,757,900					
非準備先残高	650,200					
準備預金進捗率	99.9%					
平均	32.3%					
乖離率	67.6%					

10月25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(10/25~10/26)	197	197	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マネタリーベース (億円)
 10月22日時点 6,623,100

所要	(億円)
今積期の所要準備額	3,735,100
10月26日以降の残り所要	
積数	2,800
平均	100

国債短期証券入札予定

10月29日	3ヶ月(第1034回)
11月5日	3ヶ月
11月9日	6ヶ月
11月12日	3ヶ月

国債入札予定

10月27日	2年
11月1日	10年
11月4日	物価連動
11月9日	30年

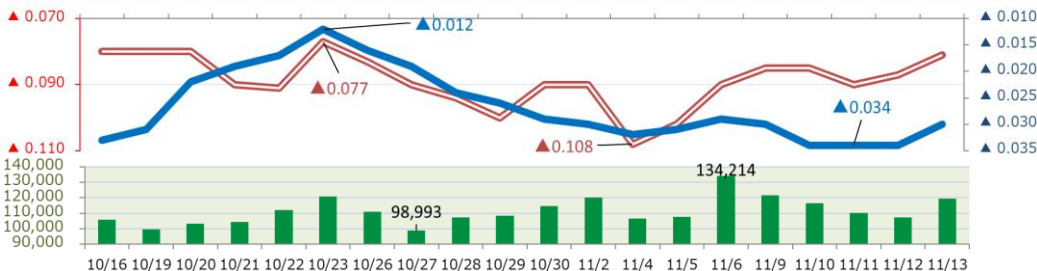
今月の国債買入オペ予定

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	月1回	10月8日	0
1年超3年以下	4500	4,500	4 8 13 20	10月20日	0
3年超5年以下	4500	4,500	4 8 20 26	10月20日	1
5年超10年以下	4250	4,250	8 13 20 26	10月20日	1
10年超25年以下	1500	1,500	4	10月4日	0
25年超	500	500	20	10月20日	0
物価連動債	600	600	月1回	9月29日	1
変動利付債<四半期>	300	300	四半期に1回	10月13日	0

1年前の市場推移

○2020年10月積み期 [10月16日~11月13日]

※積み初日及び積み最終日が祝日・休日の場合は、前営業日のレート・残高を記載しています。



東京レポレートTN (左軸上段 [%])
 無担保コールON (右軸上段 [%])
 無担保コール残高 (左軸下段 [億円])

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