



短期市場の推移

[億円] [%]

	10月21日	10月22日	10月25日	10月26日
加重平均金利	▲0.031	▲0.028	▲0.027	▲0.026
東京レボ レート(TN)	▲0.101	▲0.096	▲0.095	▲0.097
無コール残	178,692	173,937	174,774	172,049
ON	97,804	92,059	91,596	90,879
その他	80,888	81,878	83,178	81,170
有コール残	17,075	19,050	17,698	17,288

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	▲0.070	0.001	▲0.027	▲0.095
T/N	-	-	▲0.035	▲0.096
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	-	▲0.098
2W	▲0.030	▲0.008	▲0.024	▲0.099
3W	-	-	▲0.001	▲0.101
1M	▲0.005	0.070	0.016	▲0.104
2M	-	-	-	-
3M	-	-	0.070	▲0.112
6M	-	-	-	▲0.120
1Y	-	-	-	▲0.130

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28日の予定 (時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
-	10月日銀金融政策決定会合 (日銀当座預金)	▲0.1%	21:30	(米)7-9月期国内総生産 (GDP) 速報値[前期比年率]	3.0%
-	-	-	21:30	(米)新規失業保険申請件数 [前週分]	-
-	-	-	-	-	-

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▲0.018%の合出から始まり、その後は主に▲0.055%~▲0.010%の水準で合出が見られた。オファービッドともに昨日より大きな変化はなく、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
-	-	▲0.040 ~ ▲0.040	▲0.055 ~ ▲0.010

翌営業日のマーケット

引き続き地銀業態を中心に調達ニーズは強く、堅調な地合で推移すると予想。

資金需給

[億円]

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	10月27日		10月28日		10月29日	
券	▲900		▲1,500		▲1,800	
財政	▲400		▲200		+2,100	
過不足	▲1,300		▲1,700		+300	
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
国庫短期証券買入	+1,000					
国債買入	+9,500				+5,000	
共通担保(全店)	▲2,400					
CP等買入	▲200		▲100			
社債等買入			▲100			
国債補完供給	+200		+500			
新型コロナ対応金融支援特別			▲47,200		+58,200	
当座預金増減	+8,700		+9,600		+5,300	
当座預金残高	5,413,900		5,423,500		5,428,800	
準備預金残高	4,767,000				主な需給要因	
積み終了先	4,766,600					
超過準備	4,766,600					
非準備先残高	646,900					
準備預金進捗率	99.9%					
平均	38.7%					
乖離率	61.2%					

10月27日のオペ結果

[%][億円]※ミドル資金供給は百万\$

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
国債補完供給(10/27~10/28)	441	441	▲0.350	▲0.428		
	0	0				
新型コロナ対応金融支援特別(10/28~4/28)	58,238	58,238				

マネタリーベース [億円]

10月26日時点 6,626,600

所要

今積期の所要準備額 3,735,100

10月28日以降の残り所要

積数 2,000

平均 100

国庫短期証券入札予定

10月29日	3ヶ月(第1034回)
9月3日	3ヶ月
9月9日	6ヶ月
9月10日	3ヶ月
9月2日	10年
9月7日	30年
9月9日	5年
9月16日	20年

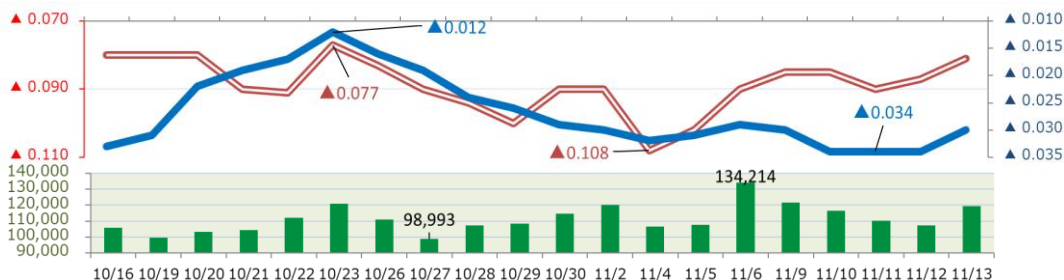
今月の国債買入オペ予定

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

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。

東京レボレート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