



短期市場の推移

	10月22日	10月25日	10月26日	10月27日
加重平均金利	▲0.028	▲0.027	▲0.026	▲0.027
東京レボレート(TN)	▲0.096	▲0.095	▲0.097	▲0.096
無コール残	173,937	174,774	172,049	169,503
ON	92,059	91,596	90,879	88,033
その他	81,878	83,178	81,170	81,470
有コール残	19,050	17,698	17,288	17,006

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	▲0.102
T/N	-	-	▲0.035	▲0.111
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.008	0.050	0.000	▲0.104
2W	▲0.035	▲0.009	▲0.018	▲0.102
3W	-	-	▲0.004	▲0.102
1M	▲0.017	0.001	▲0.007	▲0.106
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲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29日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
8:30	9月有効求人倍率	1.14倍	18:00 (欧)10月消費者物価コア指数[前年比]
8:30	9月失業率	+2.8%	18:00 (欧)7-9月期域内総生産(GDP)速報値[前年比]
8:50	9月鉱工業生産指数[前月比]	▲2.0%	-

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▲0.018%の出合から始まり、その後は主に▲0.060%~▲0.010%の水準で出合が見られた。前日に引き続き堅調な地合いとなり、同加重平均金利(速報)は前営業日対比横ばいの▲0.027%となった。日本銀行は本日の金融政策決定会合にて、金融政策の現状維持を決定した。

都銀・信託	証券	地銀
-	▲0.040	▲0.060 ~ ▲0.010

翌営業日のマーケット

調達動向に大きな変化はなく、堅調な地合いが継続すると予想。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想
	10月28日	10月29日	10月28日	10月29日	11月1日
券	▲1,600	▲300	▲1,600	▲300	+0
財政	+800	▲8,100	+800	▲8,100	▲14,000
過不足	▲800	▲8,400	▲800	▲8,400	▲14,000
金融調節	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド
CP等買入	▲100	▲3,300	▲100	▲3,300	+5,000
社債等買入	▲100	▲200	▲100	▲200	-
E T F買入	-	-	-	-	+800
国債補完供給	+500	▲300	+500	▲300	-
新型コロナ対応金融支援特別	▲47,200	+58,200	▲47,200	+58,200	-
当座預金増減	+10,200	▲5,800	+10,200	▲5,800	▲14,000
当座預金残高	5,424,100	5,418,300	5,424,100	5,418,300	5,404,300
準備預金残高	4,770,800	4,770,800	4,770,800	4,770,800	4,770,800
積み終了先	4,770,500	4,770,500	4,770,500	4,770,500	4,770,500
超過準備	4,770,500	4,770,500	4,770,500	4,770,500	4,770,500
非準備先残高	653,300	653,300	653,300	653,300	653,300
準備預金進捗率	99.9%	99.9%	99.9%	99.9%	99.9%
平均乖離率	41.9%	41.9%	41.9%	41.9%	41.9%
乖離率	58.0%	58.0%	58.0%	58.0%	58.0%

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
国債補完供給(10/28~10/29)	305	305	▲0.350	▲0.350	-	-
	0	0	-	-	-	-

※米ドル資金供給は百万\$

マネタリーベース (億円)
10月27日時点 6,636,100

所要	(億円)
今積期の所要準備額	3,735,100
10月29日以降の残り所要	-
積数	1,700
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	20	10月20日	0
物価連動債	600	600	月1回	10月26日	-
変動利付債<四半期>	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