



短期市場の推移

	10月25日	10月26日	10月27日	10月28日
加重平均金利	▲0.027	▲0.026	▲0.027	▲0.027
東京レポレート(TN)	▲0.095	▲0.097	▲0.096	▲0.111
無コール残	174,774	172,049	169,503	171,341
ON	91,596	90,879	88,033	88,521
その他	83,178	81,170	81,470	82,820
有コール残	17,698	17,288	17,006	17,083

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	▲0.087	0.001	▲0.027	▲0.093
T/N	-	-	▲0.035	▲0.096
S/N	-	-	▲0.005	-
1W	-	-	▲0.008	▲0.098
2W	▲0.040	▲0.005	▲0.029	▲0.099
3W	-	-	-	▲0.101
1M	▲0.010	0.001	▲0.004	▲0.105
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.114
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

11月1日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	23:00 (米)10月ISM製造業景況指数	60.3
-	-	-	-
-	-	-	-

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▲0.02%の出合から始まり、その後は主に▲0.060%~▲0.015%の水準で出合が見られた。三日積みとなる本日も調達サイドの動向に大きな変化はなく、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。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.063 - ▲0.063	▲0.040 - ▲0.040	▲0.060 ~ ▲0.010

翌営業日のマーケット

出し手、取り手ともに大きな動向の変化はなく、出合水準は本日対比横ばいを予想。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	10月29日	11月1日	11月1日	11月2日	11月2日	11月2日
券	▲300	+100	+100	+0	+0	+0
財政	▲9,900	▲18,400	▲18,400	▲25,000	▲25,000	▲25,000
過不足	▲10,200	▲18,300	▲18,300	▲25,000	▲25,000	▲25,000
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
CP等買入	▲3,300	+5,000	▲900			
社債等買入	▲200					
E T F買入		+800				
国債補充供給	+300	▲300	+300			
当座預金増減	▲7,900	▲18,900	▲18,900	▲25,000	▲25,000	▲25,000
当座預金残高	5,416,200	5,397,300	5,397,300	5,372,300	5,372,300	5,372,300
準備預金残高	4,777,600	主な需給要因				
積み終了先	4,777,200	国債発行・償還(2年)				
超過準備	4,777,200	国債発行(10年)				
非準備先残高	638,600	国庫短期証券発行・償還(3M)				
準備預金進捗率	99.9%					
平均	51.6%					
乖離率	48.3%					

10月29日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
国債補充供給(10/29~11/1)	231	231	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

※ドル資金供給は百万\$

マネタリーベース	所要
10月28日時点	6,647,900

所要	所要
今積期の所要準備額	3,735,100
11月1日以降の残り所要	
積数	600
平均	0

国庫短期証券入札予定

9月3日	3ヶ月
9月9日	6ヶ月
9月10日	3ヶ月
9月16日	1年
9月2日	10年
9月7日	30年
9月9日	5年
9月16日	20年

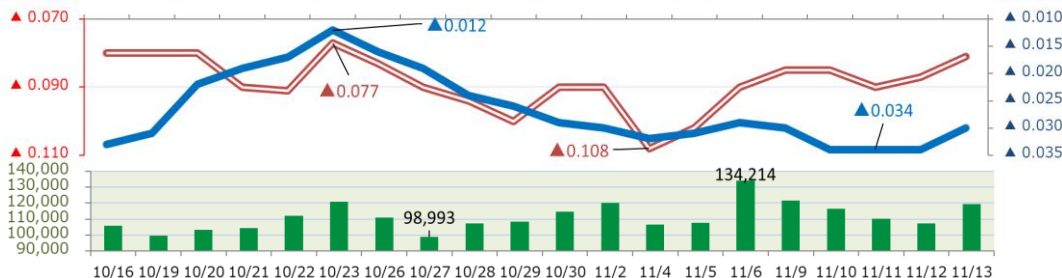
来月の国債買入オペ予定

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	2 10 17 24	10月20日	4
3年超5年以下	4500	4,500	2 10 24 29	10月26日	4
5年超10年以下	4250	4,250	10 17 24 29	10月26日	4
10年超25年以下	1500	1,500	2	10月4日	1
25年超	500	500	17	10月20日	1
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