



### 短期市場の推移

	10月26日	10月27日	10月28日	10月29日
加重平均金利	▲0.026	▲0.027	▲0.027	▲0.027
東京レボレート(TN)	▲0.097	▲0.096	▲0.111	▲0.096
無コール残	172,049	169,503	171,341	166,287
ON	90,879	88,033	88,521	86,197
その他	81,170	81,470	82,820	80,090
有コール残	17,288	17,006	17,083	16,782

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	▲0.070	0.010	▲0.029	▲0.095
T/N	-	-	▲0.040	▲0.096
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.035	▲0.001	▲0.019	▲0.098
2W	▲0.003	0.000	▲0.002	▲0.099
3W	-	-	▲0.005	▲0.101
1M	▲0.015	0.000	▲0.005	▲0.106
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.113
6M	-	-	-	▲0.120
1Y	-	-	-	▲0.131

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

### 11月2日の予定 (時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
8:50	金融政策決定会合議事要旨 (9月21~22日開催分) (日銀)		(米)FOMC (3日まで)	
8:50	10月 マネタリベース (日銀)		-	
	-		-	

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▲0.045%の割合から始まり、その後は主に▲0.045%~▲0.015%の水準で出合が見られた。一部地銀業態で調達量を制限する先も見られ、同加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.002%の▲0.029%となった。

都銀・信託		証券	地銀
▲0.068	- ▲0.068	▲0.045 - ▲0.045	▲0.045 ~ ▲0.013

### 翌営業日のマーケット

大きな地合の変化はなく、出合水準は本日対比横ばいか若干の低下を予想。

### 資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	11月1日	11月2日	11月2日	11月4日	11月4日	11月4日
券	+100	▲300	▲300	+400	+400	+400
財政	▲22,200	▲39,600	▲39,600	▲42,500	▲42,500	▲42,500
過不足	▲22,100	▲39,900	▲39,900	▲42,100	▲42,100	▲42,100
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	▲900					
国債補完供給	+300	▲200	+200			
当座預金増減	▲22,900	▲39,700	▲39,700	▲42,100	▲42,100	▲42,100
当座預金残高	5,393,300	5,353,600	5,353,600	5,311,500	5,311,500	5,311,500
準備預金残高	4,746,000	主な需給要因				
積み終了先	4,746,000	国債発行(10年)		税・保険揚げ		
超過準備	4,745,600	国庫短期証券発行・償還(3M)		国庫短期証券発行・償還(3M)		
非準備先残高	647,300					
準備預金進捗率	99.9%					
平均	54.8%					
乖離率	45.1%					

### 11月1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(11/1~11/2)	186	186	▲0.350	▲0.350		
	8	8	▲0.350	▲0.350		

マネタリベース (億円)  
10月29日時点 6,640,300

所要	(億円)
今積期の所要準備額	3,735,100
11月2日以降の残り所要	
積数	200
平均	0

### 国庫短期証券入札予定

11月5日	3ヶ月(第1035回)
11月9日	6ヶ月
11月12日	3ヶ月
11月18日	1年
11月4日	物価連動
11月9日	30年
11月16日	5年
11月18日	20年

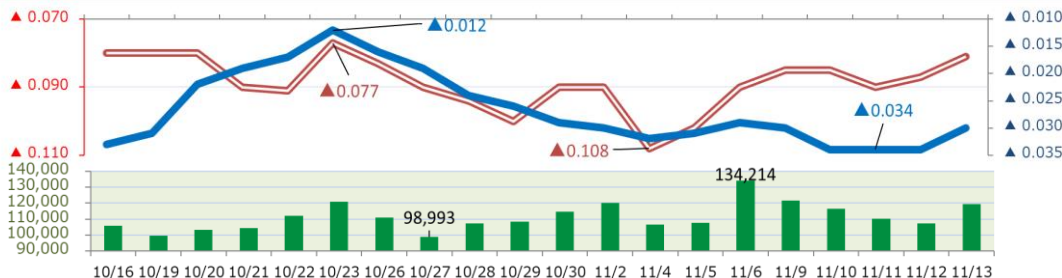
### 今月の国債買入オペ予定

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	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