



短期市場の推移

[億円] [%]

	10月20日	10月21日	10月24日	10月25日
加重平均金利	▲0.052	▲0.049	▲0.057	▲0.059
東京レポレート(TN)	▲0.082	▲0.072	▲0.075	▲0.081
無コール残	126,691	124,060	123,357	124,536
ON	63,045	58,644	57,191	59,570
その他	63,646	65,416	66,166	64,966
有コール残	32,628	33,288	33,184	31,896

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	▲0.080	0.001	▲0.060	▲0.086
T/N	-	-	-	▲0.086
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	-	▲0.091
2W	-	-	▲0.048	▲0.097
3W	-	-	-	▲0.106
1M	-	-	▲0.030	▲0.111
2M	-	-	-	-
3M	-	-	0.011	▲0.139
6M	-	-	-	▲0.141
1Y	-	-	-	▲0.133

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27日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	(欧)10月欧中銀 (ECB) 政策金利	2.00%
-	-	(米)新規失業保険申請件数 [前週分]	-
-	-	(米)7-9月期国内総生産 (GDP) 速報値[前期比年率]	2.1%

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▲0.055%の合出から始まり、その後は主に▲0.065%～▲0.055%の水準で取引された。ビッドサイド動向に大きな変化はなく、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.001%の▲0.060%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.063 ~ ▲0.060	- ~ -	▲0.060 ~ ▲0.055

翌営業日のマーケット

オファーサイド、ビッドサイド動向に大きな変化はなく、合出水準は本日対比横ばいを予想。

資金需給

[億円]

	日銀速報	日銀予想	当社需給予想
	10月26日	10月27日	10月28日
券	▲600	▲1,100	▲1,000
財政	▲14,700	+15,300	+0
過不足	▲15,300	+14,200	▲1,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国庫短期証券買入	+1,000		
国債買入	+7,800	+22,900	
共通担保(全店)	▲8,200	+10,300	
CP等買入	▲300	▲400	
国債補充供給	+16,900	+19,300	
新型コロナ対応金融支援特別		▲2,400	+2,100
当座預金増減	▲7,100	+55,700	▲1,000
当座預金残高	4,902,600	4,958,300	4,957,300
準備預金残高	4,260,400		
積み終了先	4,259,100		
超過準備	4,259,100		
非準備先残高	642,200		
準備預金進捗率	99.8%		
平均	35.5%		
乖離率	64.3%		

10月26日のオペ結果

[%][億円]※米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
国債買入(固定利回り方式)(10/27~)						
5~10年	4,912	4,912				
5~10年	0	0				
国債買入(10/27~)						
3~5年	5,750	7,850	5,755	▲0.034	▲0.030	7.0
5~10年	6,500	16,971	6,505	▲0.005	▲0.004	55.3
10~25年	3,500	8,928	3,507	▲0.050	▲0.046	10.0
25年~	1,500	3,421	1,503	▲0.110	▲0.103	53.8
CP等買入(10/31~)						
	4,000	9,110	3,975	0.001	0.012	42.4
国債補充供給(10/26~10/27)						
	19,310	19,310	▲0.350	▲0.350		
	0	0				
新型コロナ対応金融支援特別(10/27~1/27)						
	2,095	2,095				

マネタリーベース [億円]

10月25日時点 6,163,000

所要

[億円]

今積期の所要準備額	3,874,800
10月27日以降の残り所要	
積数	6,700
平均	300

国庫短期証券入札予定

10月27日	3ヶ月(第1117回)
11月4日	3ヶ月
11月9日	6ヶ月
11月11日	3ヶ月

国債入札予定

10月27日	2年
11月1日	10年
11月7日	物価連動
11月9日	30年

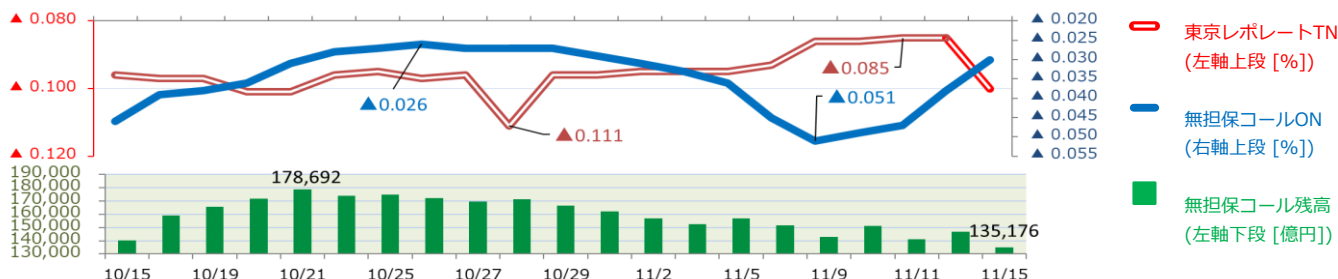
今月の国債買入オペ予定

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5日	-
1年超3年以下	4750	5,000	5 11 17 21	10月21日	0
3年超5年以下	4750	5,750	5 11 21 26	10月26日	0
5年超10年以下	5500	6,500	11 17 21 26	10月26日	0
10年超25年以下	2500	3,500	11 26	10月26日	0
25年超	1000	1,500	17 26	10月26日	0
物価連動債	600	600	月1回	10月21日	-
変動利付債<四半期>	300	300	四半期に1回	10月17日	-

1年前の市場推移

○2021年10月積み期 [10月15日~11月15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。



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(登金)第243号 加入協会 日本証券業協会