



短期市場の推移

	10月21日	10月24日	10月25日	10月26日
加重平均金利	▲0.049	▲0.057	▲0.059	▲0.060
東京レボレート(TN)	▲0.072	▲0.075	▲0.081	▲0.086
無コール残	124,060	123,357	124,536	125,367
ON	58,644	57,191	59,570	59,951
その他	65,416	66,166	64,966	65,416
有コール残	33,288	33,184	31,896	32,465

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	▲0.080	0.001	▲0.056	▲0.085
T/N	-	-	-	▲0.091
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.062	▲0.060	▲0.061	▲0.092
2W	-	-	▲0.060	▲0.099
3W	-	-	-	▲0.106
1M	-	-	-	▲0.112
2M	-	-	-	-
3M	-	-	0.001	▲0.139
6M	-	-	-	▲0.140
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

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)9月個人消費支出(PCE) 価格コア指数[前年比]	5.2%
8:30	9月有効求人倍率	1.33倍	(米)10月ミシガン大学消費者信頼感指数確報	
8:30	9月失業率	+2.5%		

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▲0.057%の合出から始まり、その後は主に▲0.060%~▲0.050%の水準で取引された。ビットサイドの調達意欲が強く、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.004%の▲0.056%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.060 ~ ▲0.060	▲0.055 ~ ▲0.055	▲0.060 ~ ▲0.050

翌営業日のマーケット

翌営業日は3日積みのため、出合水準は本日対比上昇を予想。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想
	10月27日	10月28日	10月27日	10月28日	10月31日
券	▲1,200	▲600	▲1,300	▲1,300	▲1,300
財政	+15,200	+5,800	+1,200	+1,200	+1,200
過不足	+14,000	+5,200	▲100	▲100	▲100
金融調節	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド
国債買入		+22,900		+5,700	
CP等買入	▲400		▲900		+4,000
社債等買入			▲200		
国債補充供給	+19,300	▲18,300	+18,300		
新型コロナ対応金融支援特別	▲2,400	+2,100			
当座預金増減	+37,200	+28,100	+3,900		
当座預金残高	4,939,800	4,967,900	4,971,800		
準備預金残高	4,288,500				
積み終了先	4,287,300				
超過準備	4,287,300				
非準備先残高	651,300				
準備預金進捗率	99.9%				
平均	38.7%				
乖離率	61.1%				

10月27日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
国債買入(固定利回り方式)(10/28~)						
5~10年	5,764	5,764				
5~10年	0	0				
国債補充供給(10/27~10/28)						
	18,153	18,153	▲0.350	▲0.350		
	190	190	▲0.350	▲0.350		

マナタリーベース (億円)
10月26日時点 6,156,600

所要	(億円)
今積期の所要準備額	3,874,800
10月28日以降の残り所要	
積数	5,500
平均	300

国庫短期証券入札予定

11月4日	3ヶ月
11月9日	6ヶ月
11月11日	3ヶ月
11月17日	1年
11月1日	10年
11月7日	物価連動
11月9日	30年
11月15日	5年

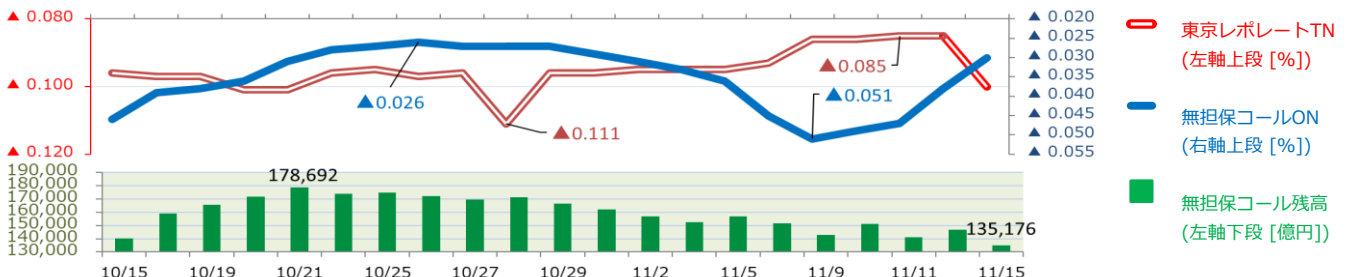
今月の国債買入オペ予定

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 近畿財務局長(登金)第243号 加入協会 日本証券業協会