



### 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	▲0.059	▲0.060	▲0.056	▲0.052
東京レポレート(TN)	▲0.081	▲0.086	▲0.091	▲0.091
無コール残	124,536	125,367	129,209	136,688
ON	59,570	59,951	63,373	71,702
その他	64,966	65,416	65,836	64,986
有コール残	31,896	32,465	31,851	33,203

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	▲0.086	0.001	▲0.062	▲0.085
T/N	-	-	-	▲0.088
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.063	▲0.060	▲0.062	▲0.092
2W	-	-	▲0.060	▲0.099
3W	-	-	-	▲0.106
1M	-	-	▲0.060	▲0.109
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.136
6M	-	-	-	▲0.139
1Y	-	-	-	▲0.132

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	50.0
	-			FOMC (1日目)	
	-				

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▲0.060%の合出から始まり、その後は主に▲0.070%~▲0.060%の水準で取引された。月末のためビッドを控える先が散見され、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.010%の▲0.062%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.070 ~ ▲0.065	▲0.065 ~ ▲0.060	▲0.065 ~ ▲0.060

### 翌営業日のマーケット

ビッドを控えていた先が取引を再開することが想定されるため、出合いの水準は上昇すると予想。

### 資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	10月31日		11月1日		11月2日	
券	+100		▲300		▲1,000	
財政	+5,300		▲35,500		▲26,000	
過不足	+5,400		▲35,800		▲27,000	
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
国庫短期証券買入				+1,000		
CP等買入	▲2,200	+4,000				
社債等買入	▲200					
国債補完供給	+23,900	▲23,700	+23,700			
当座預金増減	+7,200		▲11,100		▲27,000	
当座預金残高	4,953,100		4,942,000		4,915,000	
準備預金残高	4,305,300		主な需給要因			
積み終了先	4,304,400		国債発行・償還(2年)		税保険揚げ	
超過準備	4,304,400		普通交付税交付金		国債発行(10年)	
非準備先残高	647,800					
準備預金進捗率	99.9%					
平均	51.6%					
乖離率	48.3%					

### 10月31日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
国庫短期証券買入(11/1~)	1,000	6,938	1,001	0.012	0.014	64.7
国債買入(固定利回り方式)(11/1~)						
5~10年	0	0				
5~10年	0	0				
国債補完供給(10/31~11/1)	23,604	23,604	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

### マネタリーベース

10月28日時点 6,201,600

### 所要

今積期の所要準備額	3,874,800
11月1日以降の残り所要	
積数	1,500
平均	100

### 国庫短期証券入札予定

11月4日	3ヶ月(第1118回)
11月9日	6ヶ月
11月11日	3ヶ月
11月17日	1年

### 国債入札予定

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

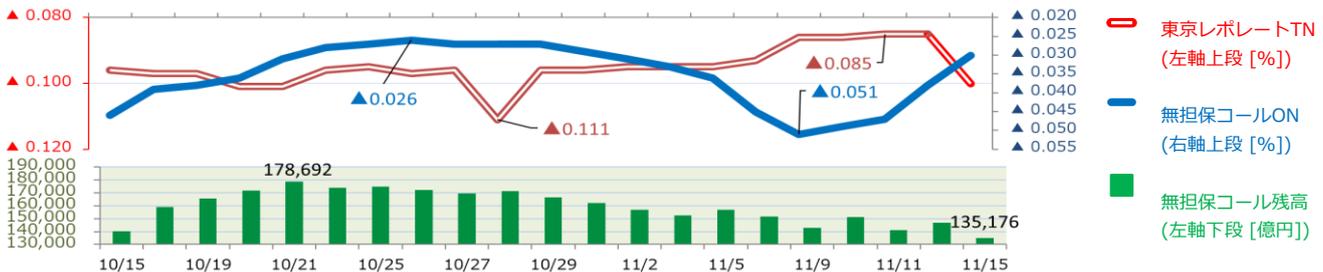
### 来月の国債買入オペ予定

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5日	1
1年超3年以下	4750	5,000	2 8 14 21	10月21日	4
3年超5年以下	4750	5,750	2 8 21 28	10月26日	4
5年超10年以下	5500	6,500	8 14 21 28	10月26日	4
10年超25年以下	2500	3,500	8 21 28	10月26日	3
25年超	1000	1,500	2 14 28	10月26日	3
物価連動債	600	600	月1回	10月21日	1
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