



### 短期市場の推移

	10月11日	10月12日	10月13日	10月14日
加重平均金利	▲0.021	▲0.032	▲0.040	▲0.052
東京レポレート(TN)	▲0.083	▲0.092	▲0.124	▲0.135
無コール残	139,305	138,007	143,526	152,472
ON	62,532	61,214	67,053	74,199
その他	76,773	76,793	76,473	78,273
有コール残	18,335	17,612	17,193	19,121

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	▲0.087	0.001	▲0.047	▲0.085
T/N	-	-	▲0.059	▲0.096
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	▲0.001	▲0.097
2W	▲0.045	0.000	▲0.016	▲0.100
3W	-	-	-	▲0.103
1M	▲0.010	0.010	0.003	▲0.106
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.113
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

### 10月18日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	22:15 (米)9月鉱工業生産指数[前月比]	0.2%
-	-	22:15 (米)9月設備稼働率	76.5%
-	-	-	-

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

9月積み期最終日である本日の無担保コールON物は▲0.020%の出合から始まり、その後は主に▲0.080%~▲0.020%の水準で出合が見られた。新積み期を意識したオファービッドの動きも見られるなか、同加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.005%の▲0.047%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.087 ~ ▲0.080	▲0.060 ~ ▲0.055	▲0.075 ~ ▲0.003

### 翌営業日のマーケット

本日調達を控えていたビッドサイドの調達意欲の強まりも想定され、出合いの水準は若干の上昇を予想。

### 資金需給

	日銀速報	日銀予想	当社需給予想
	10月15日	10月18日	10月19日
券	+100	+200	+0
財政	+57,900	▲3,600	+2,000
過不足	+58,000	▲3,400	+2,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
CP等買入	▲400	▲400	+5,000
社債等買入	▲200	-	-
国債補完供給	+100	+100	-
当座預金増減	+57,400	+1,300	+2,000
当座預金残高	5,415,700	5,417,000	5,419,000
準備預金残高	4,809,300	主な需給要因	
積み終了先	4,809,300	国庫短期証券発行・償還(3M)	
超過準備	4,809,300		
非準備先残高	606,400		
準備預金進捗率	100.0%		
平均	100.0%		
乖離率	0.0%		

### 10月15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(10/15~10/18)	55	55	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マナタリーベース 【億円】  
10月14日時点 6,575,200

所要	【億円】
来積期の所要準備額	3,735,100
10月18日以降の残り所要	
積数	15,700
平均	500

### 国庫短期証券入札予定

10月19日	1年(第1031回)
10月21日	6ヶ月(第1032回)
10月22日	3ヶ月(第1033回)
10月29日	3ヶ月
10月19日	20年
10月27日	2年
9月2日	10年
9月7日	30年

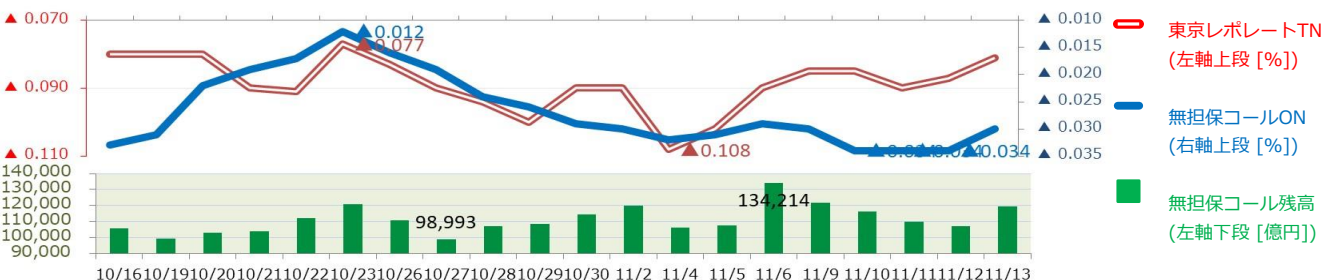
### 今月の国債買入オペ予定

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8日	0
1年超3年以下	4500	4,500	4 8 13 20	10月13日	1
3年超5年以下	4500	4,500	4 8 20 26	10月8日	2
5年超10年以下	4250	4,250	8 13 20 26	10月13日	2
10年超25年以下	1500	1,500	4	10月4日	0
25年超	500	500	20	9月24日	1
物価連動債	600	600	月1回	9月29日	1
変動利付債<四半期>	300	300	四半期に1回	10月13日	0

### 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。



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