



	10月14日	10月15日	10月18日	10月19日
加重平均金利	▲0.052	▲0.046	▲0.039	▲0.038
東京レポレート(TN)	▲0.135	▲0.096	▲0.097	▲0.097
無コール残	152,472	140,288	159,214	165,509
ON	74,199	72,665	85,531	88,991
その他	78,273	67,623	73,683	76,518
有コール残	19,121	19,853	17,672	17,502

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	▲0.075	0.001	▲0.036	▲0.096
T/N	-	-	▲0.035	▲0.101
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	▲0.001	▲0.102
2W	-	-	0.010	▲0.103
3W	-	-	▲0.001	▲0.104
1M	▲0.010	0.001	▲0.006	▲0.107
2M	-	-	-	-
3M	0.012	0.200	0.029	▲0.114
6M	-	-	-	▲0.121
1Y	-	-	-	▲0.131

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21日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	21:30 (米)新規失業保険申請件数 [前週分]	-
-	-	21:30 (米)10月フィラデルフィア連銀製造業景況指数	24.0
-	-	23:00 (米)9月景気先行指数	0.5%

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▲0.040%の出合から始まり、その後は主に▲0.055%~▲0.010%の水準で出合が見られた。同加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.002%の▲0.036%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.055 ~ ▲0.055	▲0.040 - ▲0.040	▲0.055 ~ ▲0.010

翌営業日のマーケット

引き続き都銀・地銀業態の調達ニーズが強く、出合水準は本日対比で若干の上昇と予想。

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	10月20日		10月21日		10月22日	
券	▲1,100		▲1,200		▲1,000	
財政	▲34,700		+200		+2,000	
過不足	▲35,800		▲1,000		+1,000	
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
国債買入				+13,800		
CP等買入	▲600		▲300			
E T F 買入				+500		
当座預金増減	▲36,400		+13,000		+1,000	
当座預金残高	5,386,200		5,399,200		5,400,200	
準備預金残高	4,733,400		主な需給要因			
積み終了先	4,732,900					
超過準備	4,732,800					
非準備先残高	652,800					
準備預金進捗率	99.9%					
平均	16.1%					
乖離率	83.7%					

10月20日のオペ結果 [％][徳円] ※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(10/21~)						
1~3年	4,500	13,830	4,507	0.005	0.005	54.0
3~5年	4,500	12,608	4,507	0.006	0.007	19.5
5~10年	4,250	7,927	4,257	0.007	0.008	64.0
25年~	500	2,908	502	0.014	0.015	92.0
社債等買入(10/25~)						
	750	2,514	751	0.104	0.108	67.6
国債補充供給(10/20~10/21)						
	16	16	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マネタリーベース [徳円]	所要 [徳円]
10月19日時点 6,639,400	今積期の所要準備額 3,735,100
	10月21日以降の残り所要
	積数 5,100
	平均 200

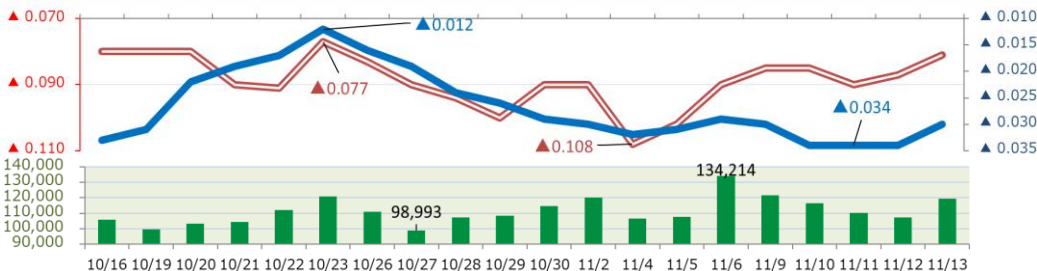
10月21日	6ヶ月(第1032回)
10月22日	3ヶ月(第1033回)
10月29日	3ヶ月
11月5日	3ヶ月

10月27日	2年
11月1日	10年
11月4日	物価連動
11月9日	30年

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20日	0
3年超5年以下	4500	4,500	4 8 20 26	10月20日	1
5年超10年以下	4250	4,250	8 13 20 26	10月20日	1
10年超25年以下	1500	1,500	4	10月4日	0
25年超	500	500	20	10月20日	0
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。



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 [徳円])

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