



## デイリーシグナル

2021年10月22日(金)

### 短期市場の推移

	10月18日	10月19日	10月20日	10月21日
加重平均金利	▲0.039	▲0.038	▲0.036	▲0.031
東京レボレート(TN)	▲0.097	▲0.097	▲0.101	▲0.101
無コール残	159,214	165,509	171,660	178,692
ON	85,531	88,991	92,332	97,804
その他	73,683	76,518	79,328	80,888
有コール残	17,672	17,502	17,203	17,075

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	▲0.028	▲0.092
T/N	▲0.035	▲0.001	▲0.031	▲0.096
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.006	▲0.003	▲0.005	▲0.099
2W	-	-	-	▲0.101
3W	-	-	-	▲0.102
1M	-	-	-	▲0.109
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.113
6M	-	-	-	▲0.121
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25日の予定 (時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
14:00	8月 景気動向指数・改定値 (内閣府)		(米) 9月 シカゴ連銀 全米活動指数	
14:00	9月 実質輸出入の動向 (日銀)		(米) 10月 ダラス連銀 製造業活動	

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。引き続き堅調な地合となり、同加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.005%の▲0.028%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

引き続き地銀態を中心に調達ニーズは強いものの、3日積み要因剥落により出合水準は本日対比で横ばいまたは若干の低下を予想。

### 資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	10月22日	10月23日	10月25日	10月26日	10月26日	10月27日
券		▲900		▲600		+0
財政		+7,700		+8,600		▲2,000
過不足		+6,800		+8,000		▲2,000
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
CP等買入	▲100		▲200			
社債等買入	▲200		▲300		+800	
国債補完供給	+500	▲200	+200			
当座預金増減		+6,800		+8,500		▲2,000
当座預金残高		5,403,100		5,411,600		5,409,600
準備預金残高		4,750,300				主な需給要因
積み終了先		4,749,900				国庫短期証券発行・償還(3M・6M)
超過準備		4,749,800				
非準備先残高		652,800				
準備預金進捗率		99.9%				
平均乖離率		29.0%				
		70.9%				

### 10月22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(10/22~10/25)	220	220	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マネタリーベース 【億円】  
10月21日時点 6,615,400

所要	【億円】
今積期の所要準備額	3,735,100
10月25日以降の残り所要	
積数	3,200
平均	100

### 国庫短期証券入札予定

10月29日	3ヶ月(第1034回)
9月3日	3ヶ月
9月9日	6ヶ月
9月10日	3ヶ月

### 国債入札予定

10月27日	2年
9月2日	10年
9月7日	30年
9月9日	5年

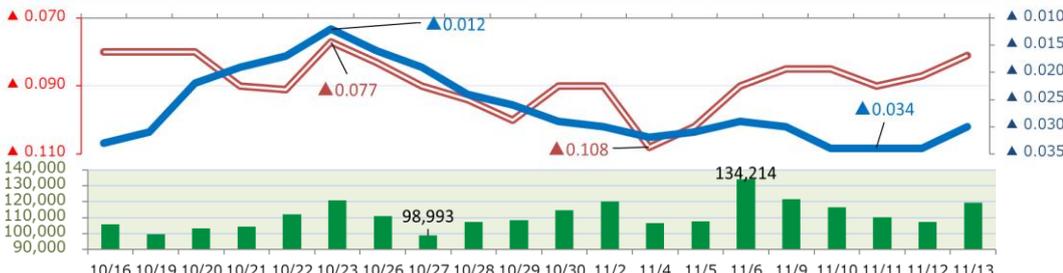
### 今月の国債買入オペ予定

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 20	10月4日	0
25年超	500	500		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 [億円])

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