



短期市場の推移

	10月5日	10月6日	10月7日	10月11日
加重平均金利	▲0.052	▲0.039	▲0.021	▲0.022
東京レポレート(TN)	▲0.129	▲0.113	▲0.087	▲0.081
無コール残	150,944	158,611	159,973	139,552
ON	83,126	85,313	86,405	72,869
その他	67,818	73,298	73,568	66,683
有コール残	32,249	32,168	31,917	31,153

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	▲0.080	0.001	▲0.026	▲0.082
T/N	-	-	-	▲0.084
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.060	▲0.020	▲0.029	▲0.090
2W	-	-	-	▲0.100
3W	-	-	-	▲0.114
1M	▲0.030	▲0.001	▲0.008	▲0.124
2M	-	-	-	-
3M	-	-	0.028	▲0.157
6M	-	-	-	▲0.151
1Y	-	-	-	▲0.144

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13日の予定 (時刻は日本時間)

時刻	日本	予想	海外	予想
	8:50	9月国内企業物価指数[前年比]	+8.8%	(米)9月消費者物価コア指数[前年比]
21:30	-	-	(米)新規失業保険申請件数[前週分]	-

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▲0.02%の出合から始まり、その後は主に▲0.030%~▲0.015%の水準で取引された。昨日対比で出合水準は若干低下し、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.004%の▲0.026%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.040 ~ ▲0.030	▲0.030 ~ ▲0.028	▲0.030 ~ ▲0.015

翌営業日のマーケット

調達意欲は大きく変わらず、出合水準は本日対比横ばい圏を予想。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	10月12日	10月13日	10月12日	10月13日	10月12日	10月13日
券	+800	▲600	+800	▲600	+1,000	+1,000
財政	+2,400	▲7,000	+2,400	▲7,000	+83,000	+83,000
過不足	+3,200	▲6,200	+3,200	▲6,200	+84,000	+84,000
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		
国債買入		+18,000				
共通担保(全店)	▲11,300	+8,200				
CP等買入	▲100					
社債等買入			▲100			
国債補完供給	+16,400	▲15,900	+15,900			
当座預金増減	+18,500	+9,200	+18,500	+9,200	+84,000	+84,000
当座預金残高	4,858,800	4,868,000	4,858,800	4,868,000	4,952,000	4,952,000
準備預金残高	4,273,400	4,273,400	4,273,400	4,273,400	4,273,400	4,273,400
積み終了先	4,273,400	4,273,400	4,273,400	4,273,400	4,273,400	4,273,400
超過準備	4,273,400	4,273,400	4,273,400	4,273,400	4,273,400	4,273,400
非準備先残高	585,400	585,400	585,400	585,400	585,400	585,400
準備預金進捗率	100.0%	100.0%	100.0%	100.0%	100.0%	100.0%
平均	90.0%	90.0%	90.0%	90.0%	90.0%	90.0%
乖離率	10.0%	10.0%	10.0%	10.0%	10.0%	10.0%

10月12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(10/13~)	1,000	7,708	1,000	0.016	0.018	54.5
国債買入(固定利回り方式)(10/13~)						
5~10年	0	0				
5~10年	0	0				
CP等買入(10/17~)	4,000	7,168	3,995	0.001	0.006	59.6
国債補完供給(10/12~10/13)	15,891	15,891	▲0.350	▲0.350		
	30	30	▲0.350	▲0.800		

マネタリーベース (億円)
10月11日時点 6,090,400

所要	今積期の所要準備額
10月13日以降の残り所要	3,744,800
積数	0
平均	0

国庫短期証券入札予定

10月14日	3ヶ月(第1114回)
10月19日	1年(第1115回)
10月21日	3ヶ月
10月27日	3ヶ月

国債入札予定

10月14日	5年
10月18日	20年
10月27日	2年
11月1日	10年

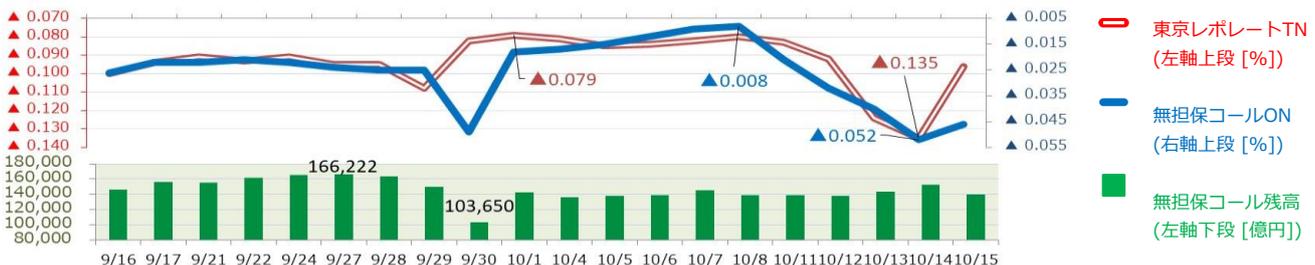
今月の国債買入オペ予定

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	0
1年超3年以下	4750	4,750	5 11 17 21	10月11日	2
3年超5年以下	4750	4,750	5 11 21 26	10月11日	2
5年超10年以下	5500	5,500	11 17 21 26	10月11日	3
10年超25年以下	2500	2,500	11 26	10月11日	1
25年超	1000	500	17 26	9月30日	2
物価連動債	600	600	月1回	9月30日	1
変動利付債<四半期>	300	300	四半期に1回	7月13日	1

1年前の市場推移

○2021年9月積み期 [9月16日~10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