



短期市場の推移

	10月6日	10月7日	10月11日	10月12日
加重平均金利	▲0.039	▲0.021	▲0.022	▲0.026
東京レボレート(TN)	▲0.113	▲0.087	▲0.081	▲0.084
無コール残	158,611	159,973	139,552	143,109
ON	85,313	86,405	72,869	77,906
その他	73,298	73,568	66,683	65,203
有コール残	32,168	31,917	31,153	33,222

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	▲0.075	0.001	▲0.033	▲0.115
T/N	-	-	-	▲0.086
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	▲0.050	▲0.092
2W	▲0.063	▲0.005	▲0.058	▲0.100
3W	-	-	-	▲0.114
1M	▲0.065	0.040	▲0.047	▲0.124
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.156
6M	-	-	-	▲0.149
1Y	-	-	-	▲0.144

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14日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
8:50	9月マネーストック	21:30	(米)9月小売売上高 0.2%
	-	23:00	(米)10月ミシガン大学消費者信頼感指数速報 59.0
	-	18:00	(欧)8月貿易収支 -

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▲0.025%の出合から始まり、その後は主に▲0.040%~▲0.015%の水準で取引された。オファーサイドの放出額の増加に伴い、出合のレートは低下しON物加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.007%の▲0.033%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.043 ~ ▲0.035	▲0.030 ~ ▲0.025	▲0.040 ~ ▲0.015

翌営業日のマーケット

3日積みではあるが、新積み期に係る取引となり、調達サイドの慎重な姿勢が伺えるため本日対比出合レートは低下を想定。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想
	10月13日	10月14日	10月14日	10月17日	10月17日
券	▲600	▲300	▲300	▲2,000	▲2,000
財政	▲8,200	+77,000	+77,000	▲27,000	▲27,000
過不足	▲8,800	+76,700	+76,700	▲29,000	▲29,000
金融調節	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド
国庫短期証券買入		+1,000		+1,800	+4,000
国債買入			▲300		
CP等買入					
社債等買入	▲100				
国債補充供給	+15,900	▲12,300	+12,300		
当座預金増減	▲4,300	+90,500	+90,500	▲25,000	▲25,000
当座預金残高	4,854,500	4,945,000	4,945,000	4,920,000	4,920,000
準備預金残高	4,238,500				
積み終了先	4,238,500		年金定時払い		国債発行(5年)
超過準備	4,238,500		社会保障費の支払い		国庫短期証券発行償還(3M)
非準備預金残高	616,000				
準備預金進捗率	100.0%				
平均	93.3%				
乖離率	6.7%				

10月13日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
国債買入(固定利回り方式)(10/14~)						
5~10年	1,774	1,774				
5~10年	0	0				
国債補充供給(10/13~10/14)						
	12,354	12,329	▲0.350	▲0.351		
	0	0				

マネタリーベース

10月12日時点 6,108,100

所要

今積期の所要準備額	3,744,800
10月14日以降の残り所要	
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
10月14日	5年
10月18日	20年
10月27日	2年
11月1日	10年

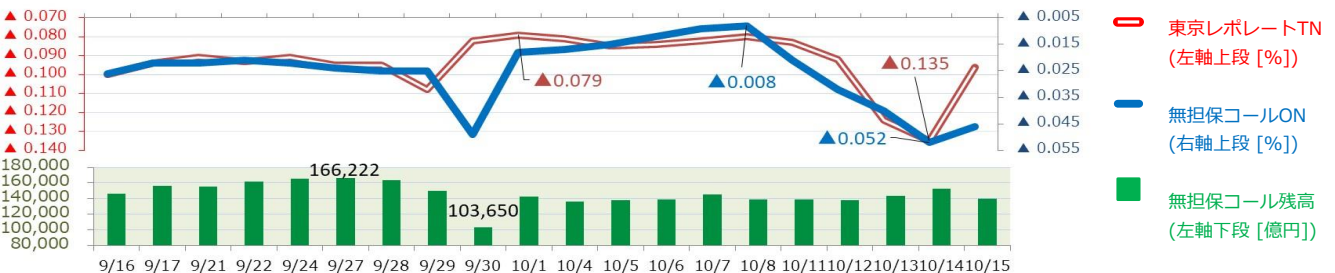
今月の国債買入オペ予定

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