



短期市場の推移

	10月12日	10月13日	10月14日	10月17日
加重平均金利	▲0.026	▲0.033	▲0.042	▲0.065
東京レポレート(TN)	▲0.084	▲0.086	▲0.086	▲0.085
無コール残	143,109	149,608	122,346	118,977
ON	77,906	85,415	63,463	60,761
その他	65,203	64,193	58,883	58,216
有コール残	33,222	30,630	32,729	33,004

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	▲0.063	▲0.084
T/N	-	-	-	▲0.085
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.065	▲0.063	▲0.064	▲0.090
2W	▲0.065	▲0.027	▲0.054	▲0.099
3W	-	-	-	▲0.108
1M	▲0.070	0.020	▲0.037	▲0.119
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.151
6M	-	-	-	▲0.146
1Y	-	-	-	▲0.142

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19日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
特になし		(欧) 9月の消費者物価(確報)	
-		(英) 9月の消費者物価(確報)	
-		-	

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▲0.065%の合出から始まり、その後は主に▲0.070%~▲0.060%の水準で取引された。合出水準はほぼ横ばいで、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.002%の▲0.063%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.075 ~ ▲0.065	▲0.070 ~ ▲0.060	▲0.070 ~ ▲0.050

翌営業日のマーケット

ビッドサイドが少し増加し、出合いの水準は本日対比やや上昇と予想。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	10月18日	10月19日	10月19日	10月20日	10月20日	10月21日
券				▲500		▲2,000
財政	+2,300			▲11,000		+1,000
過不足		+2,300		▲11,500		▲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
国庫短期証券買入				+1,000		
国債買入		+12,400		+100		
CP等買入	▲200		▲200			
社債等買入	▲100					
国債補充供給	+13,400	▲11,700	+11,700			
当座預金増減		+16,100		+1,100		▲1,000
当座預金残高		4,911,500		4,912,600		4,911,600
準備預金残高		4,273,300		主な需給要因		
積み終了先		4,252,300				
超過準備		4,222,800				
非準備先残高		638,200		国債発行(20年)		国庫短期証券発行償還(1Y)
準備預金進捗率		98.8%				
平均		9.7%				
乖離率		89.1%				

10月18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(10/19~)	1,000	7,814	1,000	0.031	0.036	
国債買入(固定利回り方式)(10/19~)						
5~10年		70	70			
5~10年		0	0			
米ドル資金供給(10/20~10/27)		1	1	3.330	3.330	
国債補充供給(10/18~10/19)		11,605	11,605	▲0.350	▲0.350	
		100	100	▲0.350	▲0.350	

マネタリーベース [億円]
10月17日時点 6,145,300

所要	今積期の所要準備額
10月19日以降の残り所要	3,874,800
積数	46,200
平均	1,700

国庫短期証券入札予定

10月19日	1年(第1115回)
10月21日	3ヶ月(第1116回)
10月27日	3ヶ月
11月4日	3ヶ月

国債入札予定

10月27日	2年
11月1日	10年
11月7日	物価連動
11月9日	30年

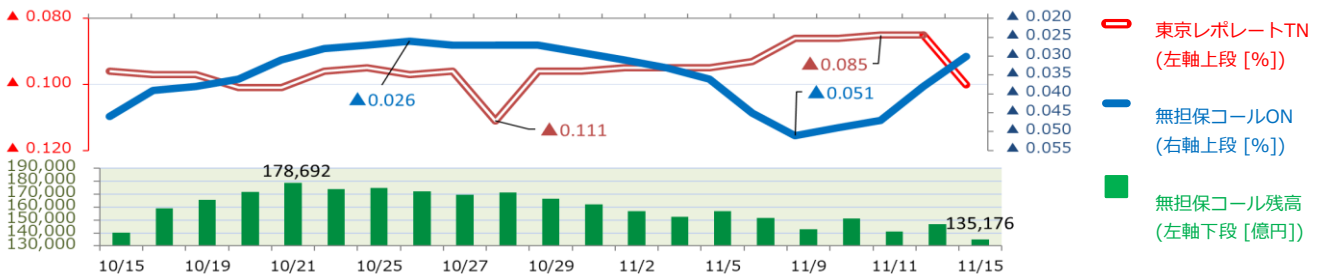
今月の国債買入オペ予定

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5日	0
1年超3年以下	4750	4,750	5 11 17 21	10月17日	1
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17日	2
10年超25年以下	2500	2,500	11 26	10月11日	1
25年超	1000	1,000	17 26	10月17日	1
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	10月17日	0

1年前の市場推移

○2021年10月積み期 [10月15日~11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