



短期市場の推移

	10月13日	10月14日	10月17日	10月18日
加重平均金利	▲0.033	▲0.042	▲0.065	▲0.063
東京レボレート(TN)	▲0.086	▲0.086	▲0.085	▲0.085
無コール残	149,608	122,346	118,977	115,094
ON	85,415	63,463	60,761	55,648
その他	64,193	58,883	58,216	59,446
有コール残	30,630	32,729	33,004	32,870

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	▲0.056	▲0.084
T/N	-	-	-	▲0.085
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	▲0.060	▲0.089
2W	▲0.058	▲0.003	▲0.047	▲0.099
3W	-	-	-	▲0.110
1M	▲0.060	▲0.010	▲0.033	▲0.119
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.149
6M	-	-	-	▲0.145
1Y	-	-	-	▲0.139

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20日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
特になし		23:00 (米)9月中古住宅販売件数	470万件
-		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▲0.055%の合出から始まり、その後は主に▲0.065%~▲0.055%の水準で取引された。ビットサイドの調達ニーズが強く、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.007%の▲0.056%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.070 ~ ▲0.065	▲0.055 ~ ▲0.055	▲0.065 ~ ▲0.048

翌営業日のマーケット

大手行の調達意欲は引き続き強く、出合水準は本日対比で上昇すると予想。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想
	10月19日	10月20日	10月20日	10月21日	10月21日
券	▲500	▲1,200	▲1,200	▲1,000	
財政	▲9,800	▲3,200	▲3,200	+2,000	
過不足	▲10,300	▲4,400	▲4,400	+1,000	
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			
国債買入		+100		+800	
CP等買入	▲200		▲400		
社債等買入			▲300		
国債補充供給	+11,700	▲11,900	+11,900		
当座預金増減	▲9,600	+7,600	+7,600	+1,000	
当座預金残高	4,901,900	4,909,500	4,909,500	4,910,500	
準備預金残高	4,273,900				主な需給要因
積み終了先	4,262,500	国庫短期証券発行償還		なし	
超過準備	4,259,200	(1Y)			
非準備先残高	628,000				
準備預金進捗率	99.2%				
平均	12.9%				
乖離率	86.3%				

10月19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)(10/20~)						
5~10年	850	850				
5~10年	0	0				
国債補充供給(10/19~10/20)						
	11,853	11,853	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マナリーベース [億円]
10月18日時点 6,161,400

所要	[億円]
今積期の所要準備額	3,874,800
10月20日以降の残り所要	
積数	31,500
平均	1,200

国庫短期証券入札予定

10月21日	3ヶ月(第1116回)
10月27日	3ヶ月
11月4日	3ヶ月
11月9日	6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

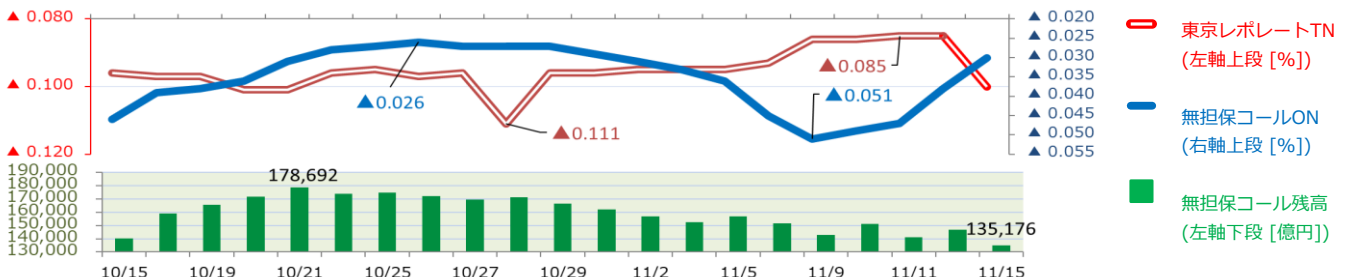
今月の国債買入オペ予定

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