



	10月14日	10月17日	10月18日	10月19日
加重平均金利	▲0.042	▲0.065	▲0.063	▲0.056
東京レポレート(TN)	▲0.086	▲0.085	▲0.085	▲0.085
無コール残	122,346	118,977	115,094	124,544
ON	63,463	60,761	55,648	62,148
その他	58,883	58,216	59,446	62,396
有コール残	32,729	33,004	32,870	33,006

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	▲0.075	0.001	▲0.052	▲0.085
T/N	-	-	-	▲0.082
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.063	▲0.060	▲0.061	▲0.087
2W	▲0.062	0.180	▲0.030	▲0.096
3W	-	-	-	▲0.106
1M	-	-	0.000	▲0.113
2M	-	-	0.001	-
3M	-	-	-	▲0.149
6M	-	-	-	▲0.143
1Y	-	-	-	▲0.135

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21日の予定 (時刻は日本時間)

時刻	日本	予想	海外	予想
	8:30	9月消費者物価 コア指数[前年比]	-	-
	-	-	-	-
	-	-	-	-

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▲0.050%の合出から始まり、その後は主に▲0.060%~▲0.050%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+0.004%の▲0.052%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.060 ~ ▲0.055	▲0.055 ~ ▲0.055	▲0.060 ~ ▲0.050

翌営業日のマーケット

週末3日積みでありビットサイドが積極的に調達することが想定され、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20日	10月21日	10月21日	10月22日	10月24日	10月25日
券	▲1,300	▲600	▲600	▲600	+1,000	+1,000
財政	▲3,600	+5,800	+5,800	+5,800	+3,000	+3,000
過不足	▲4,900	+5,200	+5,200	+5,200	+4,000	+4,000
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
国債買入		+800		+7,200		+7,200
CP等買入	▲400		▲300			
社債等買入	▲300		▲100			
国債補充供給	+11,900	▲13,700	+13,700			
当座預金増減	▲6,600	+25,700	+25,700		+4,000	+4,000
当座預金残高	4,895,300	4,921,000	4,921,000		4,925,000	4,925,000
準備預金残高	4,270,300	主な需給要因				
積み終了先	4,265,500					
超過準備	4,263,600					
非準備先残高	625,000					
準備預金進捗率	99.4%					
平均	16.1%					
乖離率	83.2%					

10月20日のオペ結果

[%][億円] ※米ドル資金供給は百万\$

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)(10/21~)						
5~10年	4,823	4,823				
5~10年	0	0				
国債買入(10/21~)						
5~10年	1,000	4,008	1,003	0.003	0.004	69.9
10~25年	1,000	2,238	1,002	0.037	0.039	59.5
25年~	500	2,022	501	0.024	0.026	35.5
社債等買入(10/25~)						
1,000	1,779	1,000	0.133	0.146	100.0	
国債補充供給(10/20~10/21)						
13,691	13,691	▲0.350	▲0.350			
0	0					

マネタリーベース [億円]
10月19日時点 6,152,300

所要 [億円]
今積期の所要準備額 3,874,800
10月21日以降の残り所要
積数 24,800
平均 1,000

国債短期証券入札予定

10月21日	3ヶ月(第1116回)
10月27日	3ヶ月(第1117回)
11月4日	3ヶ月
11月9日	6ヶ月

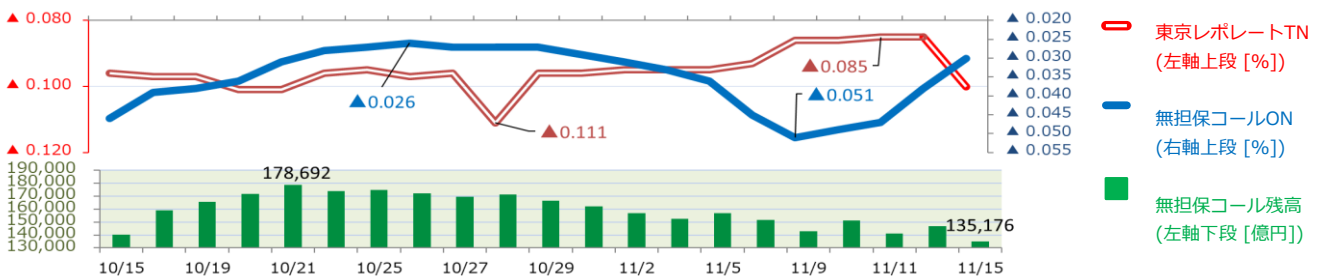
今月の国債買入オペ予定

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	1,000	11 17 21 26	10月20日	2
10年超25年以下	2500	1,000	11 26	10月20日	1
25年超	1000	500	17 26	10月20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