



### 短期市場の推移

	10月17日	10月18日	10月19日	10月20日
加重平均金利	▲0.065	▲0.063	▲0.056	▲0.052
東京レボレート(TN)	▲0.085	▲0.085	▲0.085	▲0.082
無コール残	118,977	115,094	124,544	126,691
ON	60,761	55,648	62,148	63,045
その他	58,216	59,446	62,396	63,646
有コール残	33,004	32,870	33,006	32,628

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。

### 10月24日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	-	-
-	-	-	-
-	-	-	-

経済指標及び予想値は株式会社フィスコ提供

### 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	▲0.080	0.001	▲0.049	▲0.075
T/N	-	-	-	▲0.072
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.058	0.008	▲0.044	▲0.083
2W	▲0.058	▲0.045	▲0.054	▲0.091
3W	-	-	-	▲0.103
1M	-	-	-	▲0.109
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.143
6M	-	-	-	▲0.143
1Y	-	-	-	▲0.133

### 本日の市況

本日の無担保コールON物は▲0.045%の出合から始まり、その後は主に▲0.055%~▲0.045%の水準で取引された。週末3日積みであったが、各ビットサイドの調達量が限定的であったため、大きく上げることとはなく、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.003%の▲0.049%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.070 ~ ▲0.070	- ~ -	▲0.055 ~ ▲0.045

### 翌営業日のマーケット

3日積み要因剥落による資金調達ニーズ減退のため、出合水準は本日対比低下を予想。

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

### 資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想
	10月21日	10月22日	10月24日	10月25日	10月25日
券	▲700	▲200	▲200	+1,000	
財政	+5,000	▲5,000	▲5,000	+42,000	
過不足	+4,300	▲5,200	▲5,200	+43,000	
金融調節	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド
国債買入	+7,200		+22,500		
CP等買入	▲300				
社債等買入	▲100		▲400		
国債補充供給	+13,700	▲9,700	+9,700		
当座預金増減	+15,100	+26,600	+26,600	+43,000	
当座預金残高	4,910,400	4,937,000	4,937,000	4,980,000	
準備預金残高	4,299,400				主な需給要因
積み終了先	4,296,600				国庫短期証券
超過準備	4,295,300				償還(6M)
非準備預金残高	611,000				
準備預金進捗率	99.7%				
平均	25.8%				
乖離率	73.9%				

### 10月21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)(10/24~)						
5~10年	3,717	3,717				
5~10年	0	0				
国債買入(10/24~)						
1~3年	5,000	15,489	5,001	0.002	0.006	8.8
3~5年	5,750	10,856	5,756	▲0.003	▲0.003	73.6
5~10年	6,500	19,507	6,512	▲0.002	▲0.001	76.9
10~25年	1,000	1,578	1,001	0.027	0.032	11.5
物価連動	600	3,554	602	▲0.600	▲0.608	71.7
国債補充供給(10/21~10/24)						
	9,683	9,683	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マナタリベース	所要
10月20日時点	6,147,000
今積期の所要準備額	3,874,800
10月24日以降の残り所要	
積数	12,200
平均	500

### 国庫短期証券入札予定

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

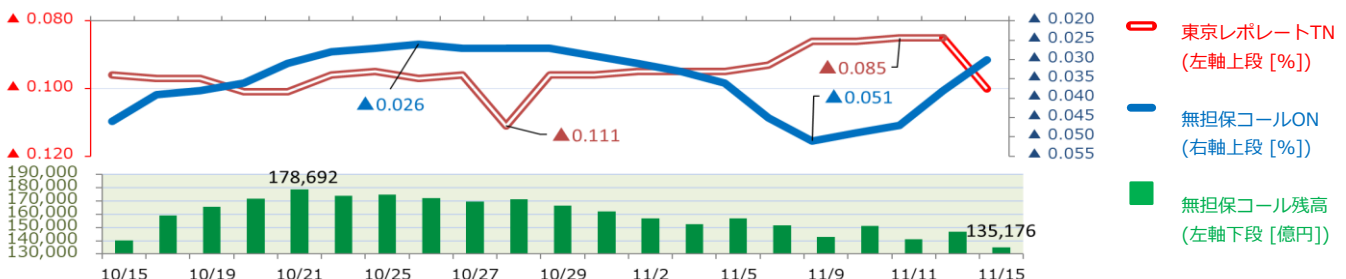
### 今月の国債買入オペ予定

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	5,000	5 11 17 21	10月21日	0
3年超5年以下	4750	5,750	5 11 21 26	10月21日	1
5年超10年以下	5500	6,500	11 17 21 26	10月21日	1
10年超25年以下	2500	1,000	11 26	10月21日	1
25年超	1000	500	17 26	10月20日	1
物価連動債	600	600	月1回	10月21日	0
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