



短期市場の推移

	10月18日	10月19日	10月20日	10月21日
加重平均金利	▲0.063	▲0.056	▲0.052	▲0.049
東京レボレート(TN)	▲0.085	▲0.085	▲0.082	▲0.072
無コール残	115,094	124,544	126,691	124,060
ON	55,648	62,148	63,045	58,644
その他	59,446	62,396	63,646	65,416
有コール残	32,870	33,006	32,628	33,288

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

[%]

10月25日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	22:00 (米)8月S&P/コアロジックCS20都市住宅価格指数[前年比]	14.00%
-	-	23:00 (米)10月消費者信頼感指数	105.0
-	-	-	-

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

	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	▲0.057	▲0.074
T/N	-	-	-	▲0.075
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.063	▲0.060	▲0.061	▲0.084
2W	▲0.060	▲0.023	▲0.049	▲0.095
3W	-	-	-	▲0.104
1M	-	-	-	▲0.108
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.143
6M	-	-	-	▲0.141
1Y	-	-	-	▲0.132

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

本日の無担保コールON物は▲0.055%の割合から始まり、その後は主に▲0.065%~▲0.050%の水準で取引された。ビットサイドの調達量が限定的であったため、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.008%の▲0.057%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.070 ~ ▲0.065	- ~ -	▲0.065 ~ ▲0.050

[%]

翌営業日のマーケット

引き続きビットサイドの調達量は限定的となり、出合水準は本日対比低下を予想。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	10月24日		10月25日		10月26日	
券	▲300		▲600		▲1,000	
財政	▲5,300		▲11,800		▲5,000	
過不足	▲5,600		▲12,400		▲6,000	
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	+22,500		+1,000		▲8,200	
共通担保(全店)						
CP等買入			▲500			
社債等買入	▲400		▲400		+1,000	
国債補充供給	+9,700		+17,000			
当座預金増減	+9,200		+5,700		▲14,200	
当座預金残高	4,919,600		4,925,300		4,911,100	
準備預金残高	4,298,000		4,295,600		4,295,400	
積み終了先	4,295,600		4,295,400		621,600	
超過準備	4,295,400		621,600		99.8%	
非準備先残高	621,600		99.8%		29.0%	
準備預金進捗率	99.8%		29.0%		70.7%	
平均	29.0%		70.7%			
乖離率	70.7%					

[億円]

10月24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)(10/25~)						
5~10年	1,046	1,046				
5~10年	0	0				
国債補充供給(10/24~10/25)						
17,016	17,016	▲0.350	▲0.350			
0	0					

マネタリーベース [億円]

10月21日時点 6,162,800

所要

今積期の所要準備額 3,874,800

10月25日以降の残り所要

積数 9,600

平均 400

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

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

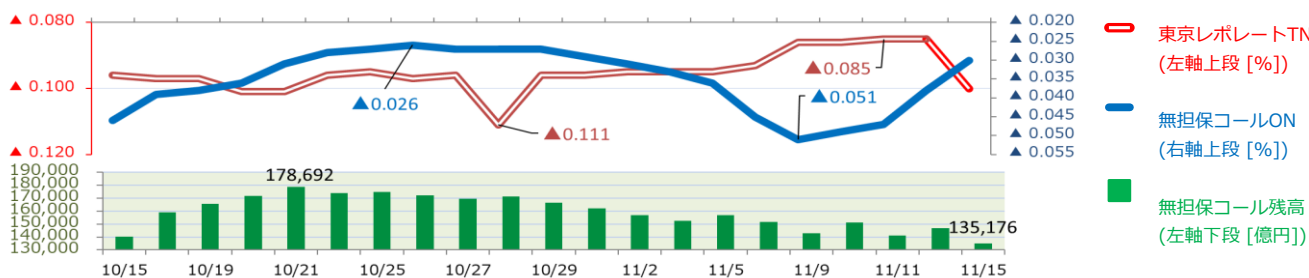
今月の国債買入オペ予定

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	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