



短期市場の推移

	10月19日	10月20日	10月21日	10月24日
加重平均金利	▲0.056	▲0.052	▲0.049	▲0.057
東京レボレート(TN)	▲0.085	▲0.082	▲0.072	▲0.075
無コール残	124,544	126,691	124,060	123,357
ON	62,148	63,045	58,644	57,191
その他	62,396	63,646	65,416	66,166
有コール残	33,006	32,628	33,288	33,184

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	▲0.080	0.001	▲0.059	▲0.076
T/N	-	-	-	▲0.081
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	▲0.060	▲0.088
2W	▲0.062	▲0.058	▲0.060	▲0.094
3W	-	-	-	▲0.104
1M	-	-	-	▲0.109
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.142
6M	-	-	-	▲0.141
1Y	-	-	-	▲0.134

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26日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
8:50	9月企業向けサービス価格	(米) 週間MBA住宅ローン申請件数	
	-	(米) 9月財の貿易収支	
	-	-	

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。動態に主だった変化は見られず、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.002%の▲0.059%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.070 ~ ▲0.060	▲0.065 ~ ▲0.055	▲0.065 ~ ▲0.055

翌営業日のマーケット

オファーサイド、ビッドサイド共に大きな動きは見られないため、出合水準は本日対比横ばいを想定する。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	10月25日	10月26日	10月26日	10月27日	10月27日	10月27日
券	▲700	▲500	▲500	+0		
財政	▲10,400	▲11,900	▲11,900	+14,000		
過不足	▲11,100	▲12,400	▲12,400	+14,000		
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	+7,800		
国債買入		+1,000		+7,800		
共通担保(全店)			▲8,200	+10,300		
CP等買入	▲500		▲300			
社債等買入	▲400	+1,000				
国債補充供給	+17,000	▲16,900	+16,900			
新型コロナ対応金融支援特別					▲2,400	
当座預金増減	▲9,900	+15,100	+15,100	+11,600		
当座預金残高	4,909,700	4,924,800	4,924,800	4,936,400		
準備預金残高	4,276,600					
積み終了先	4,275,400					
超過準備	4,275,000					
非準備先残高	633,100					
準備預金進捗率	99.8%					
平均	32.3%					
乖離率	67.5%					

10月25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(10/26~)	1,000	6,173	1,001	0.011	0.019	9.5
国債買入(固定利回り方式)(10/26~)						
5~10年		7,863	7,863			
5~10年		0	0			
米ドル資金供給(10/27~11/4)		0	0	3.330	3.330	
国債補充供給(10/25~10/26)		16,905	16,905	▲0.350	▲0.350	
共通担保(全店)(10/26~11/9)		10,300	10,300			

マナリーベース (億円)
10月24日時点 6,172,300

所要	(億円)
今積期の所要準備額	3,874,800
10月26日以降の残り所要	
積数	8,100
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
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

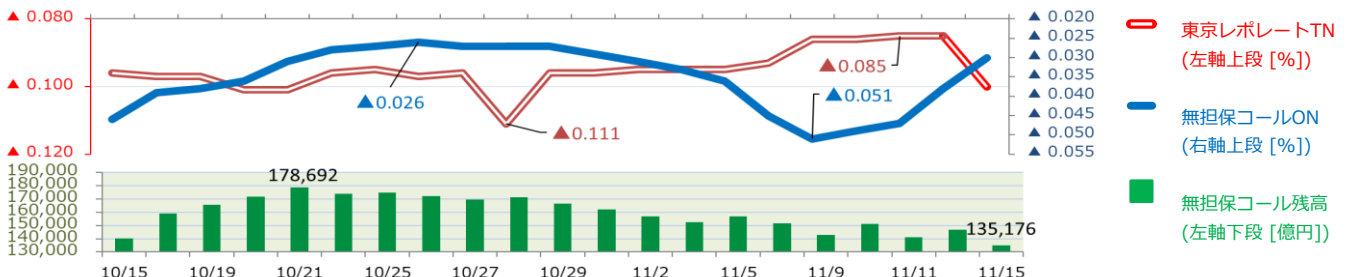
今月の国債買入オペ予定

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