



### 短期市場の推移

	10月11日	10月12日	10月13日	10月14日
加重平均金利	▲0.022	▲0.026	▲0.033	▲0.042
東京レボレート(TN)	▲0.081	▲0.084	▲0.086	▲0.086
無コール残	139,552	143,109	149,608	122,346
ON	72,869	77,906	85,415	63,463
その他	66,683	65,203	64,193	58,883
有コール残	31,153	33,222	30,630	32,729

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	▲0.080	0.001	▲0.065	▲0.084
T/N	-	-	-	▲0.085
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.063	▲0.055	▲0.061	▲0.091
2W	▲0.065	0.100	▲0.060	▲0.098
3W	-	-	-	▲0.110
1M	▲0.065	▲0.028	▲0.060	▲0.121
2M	-	-	-	-
3M	-	-	0.010	▲0.152
6M	-	-	-	▲0.147
1Y	-	-	-	▲0.143

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18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

### 本日の市況

本日の無担保コールON物は▲0.060%の合出から始まり、その後は主に▲0.070%~▲0.060%の水準で取引された。新積み期に入りビッドを控える先が散見され、出合のレートは低下し、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.023%の▲0.065%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.075 ~ ▲0.075	▲0.070 ~ ▲0.065	▲0.070 ~ ▲0.060

### 翌営業日のマーケット

ビッドサイドの動向に大きな変化はなく、出合いの水準は本日対比横ばい圏と予想。

### 資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	10月17日		10月18日		10月19日	
券	+300		+0		▲2,000	
財政	▲41,100		+1,900		▲12,000	
過不足	▲40,800		+1,900		▲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
国債買入		+1,200		+12,400		
CP等買入	▲500	+4,000	▲200			
社債等買入			▲100			
国債補完供給	+14,000	▲13,400	+13,400			
当座預金増減	▲35,500		+27,400		▲14,000	
当座預金残高	4,895,400		4,922,800		4,908,800	
準備預金残高	4,262,200		主な需給要因			
積み終了先	4,145,300		国債発行(20年)			
超過準備	3,741,800					
非準備先残高	633,200					
準備預金進捗率	97.5%					
平均	6.5%					
乖離率	91.0%					

### 10月17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)(10/18~)						
5~10年	870	870				
5~10年	0	0				
国債買入(10/18~)						
1~3年	4,750	15,554	4,756	▲0.001	0.001	62.9
5~10年	5,500	16,729	5,509	0.005	0.007	91.5
25年~	1,000	3,915	1,006	0.035	0.039	14.2
変動利付	300	300	300	▲1.450	▲1.452	
国債補完供給(10/17~10/18)						
	12,911	12,911	▲0.350	▲0.350		
	436	436	▲0.350	▲0.350		

マネタリーベース	所要
10月14日時点	今積期の所要準備額
6,181,100	3,874,800
	10月18日以降の残り所要
	積数
	96,900
	平均
	3,300

### 国債短期証券入札予定

10月19日	1年(第1115回)
10月21日	3ヶ月(第1116回)
10月27日	3ヶ月
11月4日	3ヶ月

### 国債入札予定

10月18日	20年
10月27日	2年
11月1日	10年
11月7日	物価連動

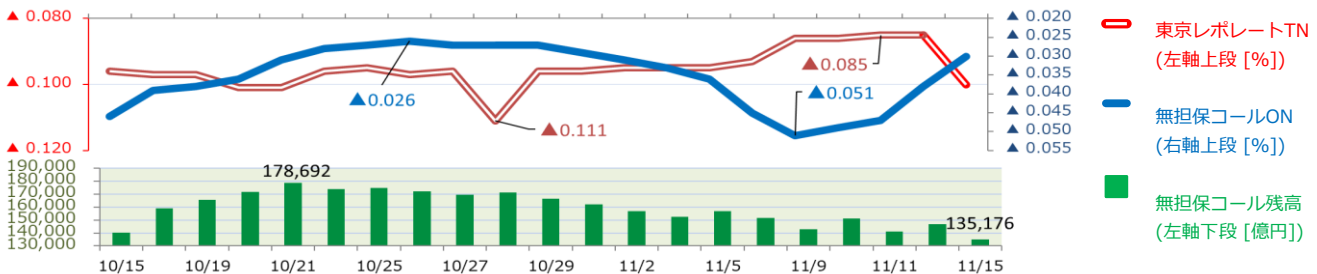
### 今月の国債買入オペ予定

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