



### 短期市場の推移

	9月26日	9月27日	9月28日	9月29日
加重平均金利	▲0.051	▲0.064	▲0.063	▲0.062
東京レポレート(TN)	▲0.251	▲0.397	▲0.547	▲0.135
無コール残	205,074	203,706	215,795	122,880
ON	117,461	112,213	125,522	77,037
その他	87,613	91,493	90,273	45,843
有コール残	21,860	22,837	21,895	19,694

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	▲0.087	0.001	▲0.044	▲0.122
T/N	-	-	-	▲0.131
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.060	▲0.013	▲0.050	▲0.148
2W	▲0.058	0.030	▲0.038	▲0.154
3W	-	-	▲0.045	▲0.160
1M	▲0.045	0.000	▲0.027	▲0.163
2M	-	-	-	-
3M	-	-	0.030	▲0.194
6M	-	-	-	▲0.125
1Y	-	-	-	▲0.085

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3日の予定 (時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
8:50	マネタリーベース (8月)			
8:50	9月調査の日銀短観 (調査全容)			
15:00	財政資金対民間収支の実績 (9月)			

### 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▲0.050%~▲0.030%の水準で取引された。半期末に調達を控えていた先を中心に調達意欲が強まりON物加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.018%の▲0.044%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.060 ~ ▲0.040	- ~ -	▲0.050 ~ ▲0.030

### 翌営業日のマーケット

ビットサイドの調達意欲は強く、出合水準は本日対比上昇を想定。

### 資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	10月2日		10月3日		10月4日	
券	+400		+200		+0	
財政	▲28,000		▲14,000		▲72,000	
過不足	▲27,600		▲13,800		▲72,000	
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	+3,000					
CP等買入	▲200					
国債補完供給	+48,400	▲40,400	+40,400			
当座預金増減	▲16,800		+26,600		▲72,000	
当座預金残高	5,455,200		5,481,800		5,409,800	
準備預金残高	4,759,800		主な需給要因			
積み終了先	4,759,100		国債発行 (10年)			
超過準備	4,759,100		法人税・消費税・年金保険揚げ			
非準備先残高	695,400					
準備預金進捗率	99.9%					
平均	56.7%					
乖離率	43.2%					

### 10月2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)(10/3~)						
5~10年	0	0				
5~10年	0	0				
国債補完供給(10/2~10/3)						
	41,126	41,126	▲0.350	▲0.351		
	0	0				

マネタリーベース [億円]  
9月29日時点 6,726,100

所要	[億円]
今積期の所要準備額	3,882,600
10月3日以降の残り所要	
積数	3,600
平均	300

### 国債短期証券入札予定

10月5日	6ヶ月(第1186回)
10月6日	3ヶ月(第1187回)
10月13日	3ヶ月
10月19日	1年

### 国債入札予定

10月3日	10年
10月5日	30年
10月11日	5年
10月17日	20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	9月13日	1
1年超3年以下	3,500~6,500	4,250	4 10 16 23	9月20日	4
3年超5年以下	4,000~7,500	4,500	4 16 23 27	9月27日	4
5年超10年以下	4,500~9,000	3,000	10 16 23 27	9月29日	4
10年超25年以下	1,000~5,000	2,000	4 10 23 27	9月27日	4
25年超	500~3,500	1,000	10 16 27	9月27日	3
物価連動債	600	600	月1回	9月27日	1
変動利付債	-	300	-	4月14日	-

### 1年前の市場推移

○2022年9月積み期 [9月16日~10月14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