



短期市場の推移

	9月27日	9月28日	9月29日	10月2日
加重平均金利	▲0.064	▲0.063	▲0.062	▲0.044
東京レボレート(TN)	▲0.397	▲0.547	▲0.135	▲0.131
無コール残	203,706	215,795	122,880	158,378
ON	112,213	125,522	77,037	93,240
その他	91,493	90,273	45,843	65,138
有コール残	22,837	21,895	19,694	26,806

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	▲0.087	0.001	▲0.031	▲0.122
T/N	-	-	-	▲0.150
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.060	▲0.025	▲0.026	▲0.162
2W	▲0.029	▲0.023	▲0.026	▲0.163
3W	-	-	-	▲0.170
1M	-	-	▲0.027	▲0.181
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.201
6M	-	-	-	▲0.126
1Y	-	-	-	▲0.087

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4日の予定 (時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
8:50	日銀当座預金増減要因 (10月見込み)		21:15	(米) ADP雇用統計
			23:00	(米) ISM非製造業指数

本日の市況

本日の無担保コールON物は▲0.025%の出合から始まり、その後は主に▲0.05~▲0.02%のレンジで取引された。ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.013%の▲0.031%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.050 ~ ▲0.038	▲0.075 ~ ▲0.075	▲0.040 ~ ▲0.010

翌営業日のマーケット

堅調な地合いが継続すると予想。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想
	10月3日	10月4日	10月4日	10月5日	10月5日
券		+200		+0	▲1,000
財政		▲16,200		▲68,700	+0
過不足		▲16,000		▲68,700	▲1,000
金融調節	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド
国庫短期証券買入				+1,000	
CP等買入				▲100	
国債補完供給	+40,400	▲38,000	+38,000		
当座預金増減		▲13,600		▲29,800	▲1,000
当座預金残高		5,441,600		5,411,800	5,410,800
準備預金残高		4,732,000			
積み終了先		4,731,100			
超過準備		4,731,100			
非準備先残高		709,600			
準備預金進捗率		99.9%			
平均		60.0%			
乖離率		39.9%			

10月3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(10/4~)	1,000	6,645	1,001	0.010	0.013	61.1
国債買入(固定利回り方式)(10/4~)						
5~10年		0	0			
5~10年		0	0			
米ドル資金供給(10/5~10/12)		0	0	5.580	5.580	
国債補完供給(10/3~10/4)		38,730	38,730	▲0.350	▲0.351	
		0	0			

マナタリーベース (億円)
 10月2日時点 6,708,900

所要	(億円)
今積期の所要準備額	3,882,600
10月4日以降の残り所要	
積数	2,700
平均	200

国庫短期証券入札予定

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5日	30年
10月11日	5年
10月17日	20年
10月30日	2年

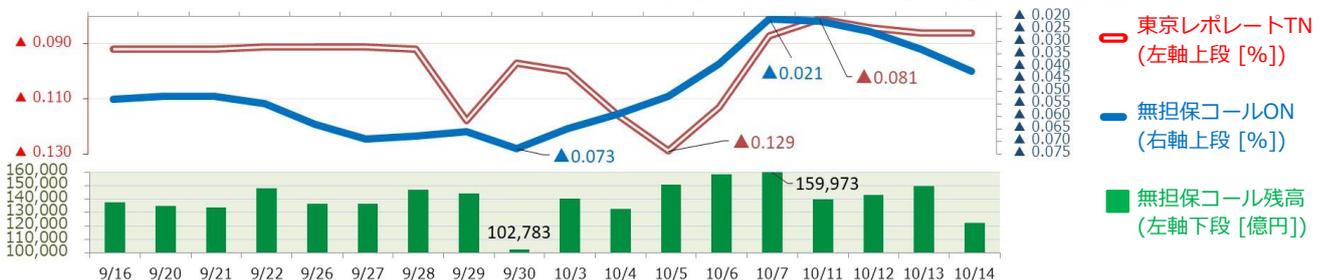
今月の国債買入オペ予定

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