



短期市場の推移

	9月28日	9月29日	10月2日	10月3日
加重平均金利	▲0.063	▲0.062	▲0.044	▲0.031
東京レポレート(TN)	▲0.547	▲0.135	▲0.131	▲0.150
無コール残	215,795	122,880	158,378	175,480
ON	125,522	77,037	93,240	104,632
その他	90,273	45,843	65,138	70,848
有コール残	21,895	19,694	26,806	27,645

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	▲0.021	▲0.103
T/N	-	-	-	▲0.131
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.018	0.005	▲0.012	▲0.156
2W	▲0.025	▲0.005	▲0.020	▲0.162
3W	-	-	-	▲0.170
1M	-	-	0.001	▲0.180
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.201
6M	-	-	-	▲0.126
1Y	-	-	-	▲0.087

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5日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
		(米) 8月貿易収支	

本日の市況

本日の無担保コールON物は▲0.020%の出合から始まり、その後は主に▲0.025%~▲0.015%の水準で取引された。引き続きビッドサイドの資金調達意欲は強く、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.010%の▲0.021%となった。本日、日本銀行は10月6日に貸付期間5年の共通担保資金供給オペを実施することを発表した。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.040 ~ ▲0.020	- ~ -	▲0.035 ~ ▲0.010

翌営業日のマーケット

引き続きビッドサイドの資金調達意欲は強く、堅調な地合が継続すると予想。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	10月4日		10月5日		10月6日	
券	▲100		▲200		+0	
財政	▲64,600		+100		▲7,000	
過不足	▲64,700		▲100		▲7,000	
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				
国債買入				+18,900		
CP等買入	▲100		▲100			
国債補完供給	+38,000	▲43,600	+43,600			
当座預金増減	▲69,400		+62,300		▲7,000	
当座預金残高	5,372,200		5,434,500		5,427,500	
準備預金残高	4,692,900		主な需給要因			
積み終了先	4,692,200		国債発行(30年)			
超過準備	4,692,200					
非準備先残高	679,300					
準備預金進捗率	99.9%					
平均	63.3%					
乖離率	36.6%					

10月4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)(10/5~)						
5~10年	0	0				
5~10年	0	0				
国債買入(10/5~)						
~1年	1,500	2,161	1,501	▲0.028	0.009	60.7
1~3年	4,250	13,478	4,253	0.008	0.011	18.0
3~5年	4,500	7,116	4,501	0.009	0.015	87.9
5~10年	6,750	18,181	6,756	0.021	0.023	48.5
10~25年	2,000	7,790	2,006	0.036	0.038	79.4
国債補完供給(10/4~10/5)						
	44,406	44,406	▲0.450	▲0.453		
	0	0				

マネタリーベース [億円]
10月3日時点 6,695,200

所要	所要
今積期の所要準備額	3,882,600
10月5日以降の残り所要	
積数	1,900
平均	200

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

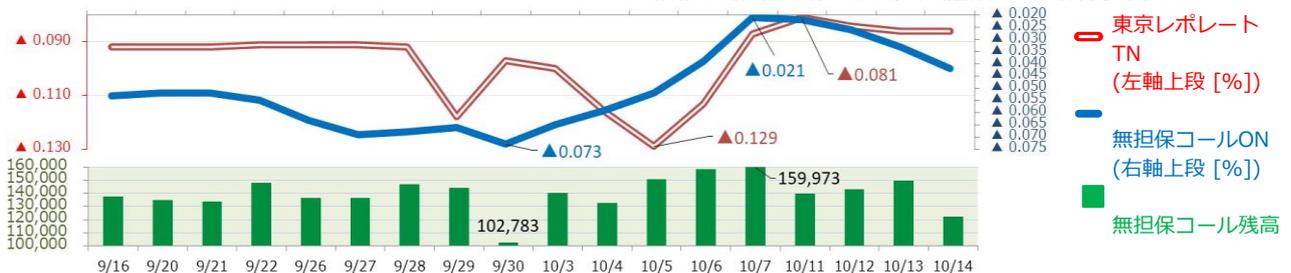
今月の国債買入オペ予定

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4日	0
1年超3年以下	3,500~6,500	4,250	4 10 16 23	10月4日	3
3年超5年以下	4,000~7,500	4,500	4 16 23 27	10月4日	3
5年超10年以下	4,500~9,000	6,750	10 16 23 27	10月4日	4
10年超25年以下	1,000~5,000	2,000	4 10 23 27	10月4日	3
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