



短期市場の推移

	9月29日	10月2日	10月3日	10月4日
加重平均金利	▲0.062	▲0.044	▲0.031	▲0.021
東京レポレート(TN)	▲0.135	▲0.131	▲0.150	▲0.131
無コール残	122,880	158,378	175,480	185,815
ON	77,037	93,240	104,632	114,212
その他	45,843	65,138	70,848	71,603
有コール残	19,694	26,806	27,645	26,698

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	▲0.015	▲0.101
T/N	-	-	▲0.020	▲0.119
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.040	▲0.001	▲0.018	▲0.150
2W	-	-	▲0.015	▲0.161
3W	-	-	-	▲0.166
1M	-	-	0.250	▲0.178
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.200
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6日の予定 (時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
15:00	コール市場残高(9月)		21:30	米 雇用統計(9月)

本日の市況

本日の無担保コールON物は▲0.008%の出合から始まり、その後は主に▲0.020%~▲0.007%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+0.006%の▲0.015%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.040 ~ ▲0.015	- ~ -	▲0.035 ~ ▲0.007

翌営業日のマーケット

週末4日積みであり、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5日	10月6日	10月6日	10月10日	10月10日	10月10日
券	▲200		+0	+1,000		
財政	▲700		▲10,900	+14,000		
過不足	▲900		▲10,900	+15,000		
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		+18,900				
CP等買入	▲100		▲600			
国債補完供給	+43,600	▲41,900	+41,900			
当座預金増減	+19,600		+30,400		+15,000	
当座預金残高	5,391,800		5,422,200		5,437,200	
準備預金残高	4,708,700		主な需給要因			
積み終了先	4,708,500		国債発行(30年)		国庫短期証券発行・償還(3M・6M)	
超過準備	4,707,900					
非準備先残高	683,100					
準備預金進捗率	99.9%					
平均	66.7%					
乖離率	33.2%					

10月5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)(10/6~)						
5~10年	0	0				
5~10年	0	0				
国債補完供給(10/5~10/6)						
	42,844	42,844	▲0.350	▲0.351		
	0	0				

マネタリーベース (億円)
 10月4日時点 6,625,800

所要	(億円)
今積期の所要準備額	3,882,600
10月6日以降の残り所要	
積数	1,100
平均	100

国庫短期証券入札予定

10月6日	3ヶ月(第1187回)
10月13日	3ヶ月
10月19日	1年
10月20日	3ヶ月

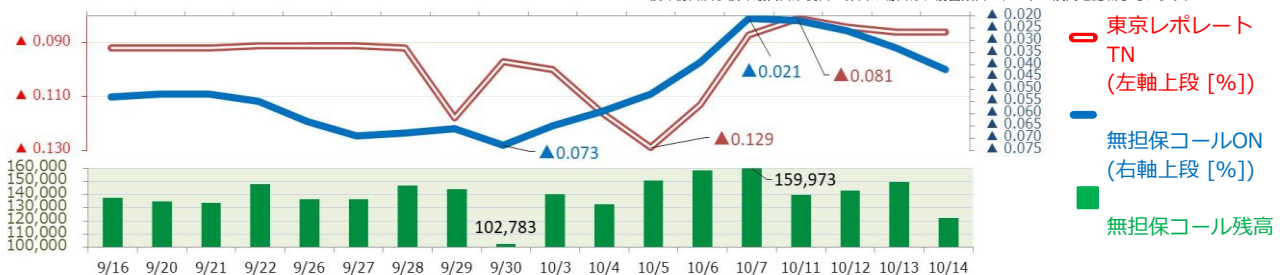
今月の国債買入オペ予定

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