



	10月3日	10月4日	10月5日	10月6日
加重平均金利	▲0.031	▲0.021	▲0.015	▲0.016
東京レポレート(TN)	▲0.150	▲0.131	▲0.119	▲0.103
無コール残	175,480	185,815	181,595	183,069
ON	104,632	114,212	108,587	109,651
その他	70,848	71,603	73,008	73,418
有コール残	27,645	26,698	26,294	26,746

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	▲0.030	▲0.101
T/N	-	-	-	▲0.107
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.040	0.010	▲0.035	▲0.146
2W	▲0.050	0.001	▲0.047	▲0.161
3W	-	-	-	▲0.168
1M	-	-	-	▲0.177
2M	-	-	0.015	-
3M	0.001	0.030	0.016	▲0.200
6M	-	-	-	▲0.126
1Y	-	-	-	▲0.086

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11日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	米 FOMC議事録 (9月19日~20日)	-
-	-	-	-
-	-	-	-

本日の市況

本日の無担保コールON物は▲0.022%の合出から始まり、その後は主に▲0.050%~▲0.020%の水準で取引された。4日積み要因剥落により、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.014%の▲0.030%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.040 ~ ▲0.040	~	▲0.050 ~ ▲0.020

翌営業日のマーケット

オファービッド共に大きな動向変化はなく、出合水準は横ばい圏を想定。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	10月10日	10月11日	10月10日	10月11日	10月10日	10月11日
券	+200	+500	+200	+500	+1,000	+1,000
財政	▲5,600	▲3,800	▲5,600	▲3,800	▲23,000	▲23,000
過不足	▲5,400	▲3,300	▲5,400	▲3,300	▲24,000	▲24,000
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						
共通担保(全店)		+10,000	▲8,500	+6,400		
CP等買入	▲100		▲500			
国債補完供給	+40,100	▲43,200	+43,200			
当座預金増減	+1,400	+51,400	+1,400	+51,400	▲24,000	▲24,000
当座預金残高	5,382,100	5,433,500	5,382,100	5,433,500	5,409,500	5,409,500
準備預金残高	4,722,500		4,722,500			
積み終了先	4,722,400		4,722,400			
超過準備	4,722,400		4,722,400			
非準備先残高	659,600		659,600			
準備預金進捗率	99.9%		99.9%			
平均	83.3%		83.3%			
乖離率	16.6%		16.6%			

10月10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)(10/11~)						
5~10年	0	0	0			
5~10年	0	0	0			
国債買入(10/11~)						
1~3年	4,250	10,415	4,253	▲0.008	▲0.006	2.6
5~10年	6,750	14,421	6,762	▲0.038	▲0.037	91.7
10~25年	2,000	5,294	2,007	▲0.032	▲0.031	59.6
25年~	1,000	3,481	1,005	▲0.032	▲0.031	56.5
米ドル資金供給(10/12~10/19)						
	0	0	5,580	5,580		
国債補完供給(10/10~10/11)						
	44,079	44,079	▲0.350	▲0.351		
	0	0				
共通担保(全店)(10/11~10/25)						
	6,360	6,360				

マネタリーベース [億円]
 10月6日時点 6,634,500

所要 [億円]
 今積期の所要準備額 3,887,300
 10月11日以降の残り所要
 積数 300
 平均 100

国債短期証券入札予定

10月13日	3ヶ月(第1188回)
10月19日	1年
10月20日	3ヶ月
10月27日	3ヶ月

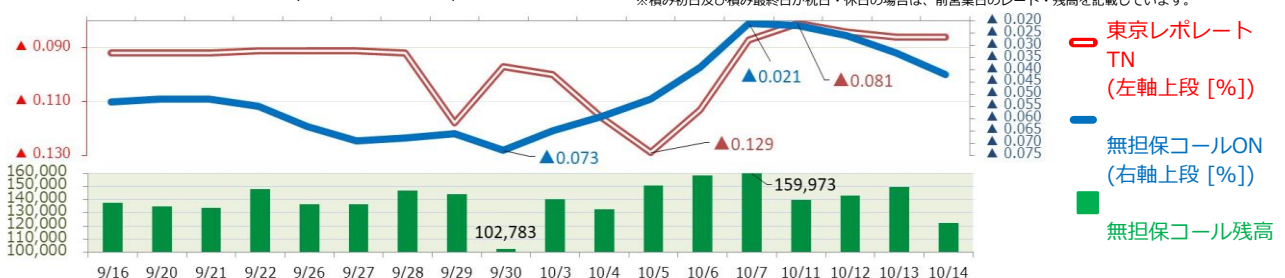
今月の国債買入オペ予定

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10日	2
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10日	3
10年超25年以下	1,000~5,000	2,000	4 10 23 27	10月10日	2
25年超	500~3,500	1,000	10 16 27	10月10日	2
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