



|             | 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      |         |        | ▲1,000    | ▲1,000    |
| 財政       | ▲5,600    | ▲3,800    |         |        | ▲23,000   | ▲23,000   |
| 過不足      | ▲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     |           |           |         |        | +14,100   | +14,100   |
| 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   |         |        | ▲24,000   | ▲24,000   |
| 当座預金残高   | 5,382,100 | 5,433,500 |         |        | 5,409,500 | 5,409,500 |
| 準備預金残高   | 4,722,500 |           |         |        |           |           |
| 積み終了先    | 4,722,400 |           |         |        |           |           |
| 超過準備     | 4,722,400 |           |         |        |           |           |
| 非準備先残高   | 659,600   |           |         |        |           |           |
| 準備預金進捗率  | 99.9%     |           |         |        |           |           |
| 平均       | 83.3%     |           |         |        |           |           |
| 乖離率      | 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      |        |        |        |      |
| 5~10年                 | 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年超                  | 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