



### 短期市場の推移

	10月5日	10月6日	10月10日	10月11日
加重平均金利	▲0.015	▲0.016	▲0.030	▲0.033
東京レボレート(TN)	▲0.119	▲0.103	▲0.107	▲0.109
無コール残	181,595	183,069	174,486	177,055
ON	108,587	109,651	101,238	104,007
その他	73,008	73,418	73,248	73,048
有コール残	26,294	26,746	27,222	27,888

[億円] [%]

### 10月13日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想

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	▲0.029	▲0.108
T/N	-	-	▲0.030	▲0.146
S/N	-	-	▲0.020	-
1W	▲0.045	0.010	▲0.034	▲0.153
2W	-	-	0.001	▲0.175
3W	-	-	-	▲0.182
1M	-	-	-	▲0.190
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.199
6M	-	-	-	▲0.126
1Y	-	-	-	▲0.086

### 本日の市況

本日の無担保コールON物は▲0.025%の合出から始まり、その後は主に▲0.030%~▲0.020%の水準で取引された。オファー・ビッドの動向に大きな変化は見られず、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.004%の▲0.029%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.040 ~ ▲0.027	~	▲0.035 ~ ▲0.020

### 翌営業日のマーケット

オファー・ビッドの動向に大きな変化はなく、出合水準は横ばい圏を想定。

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

### 資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	10月12日	10月13日	10月13日	10月16日	10月16日	10月16日
券		▲900	+400			+0
財政		▲17,600	+78,200			▲2,000
過不足		▲18,500	+78,600			▲2,000
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				
CP等買入	▲100		▲200			
社債等買入			▲1,200			
E T F買入				+700		
国債補充供給	+42,600	▲43,800	+43,800			
当座預金増減		▲18,800	+121,700			▲2,000
当座預金残高		5,372,200	5,493,900			5,491,900
準備預金残高		4,698,100				
積み終了先		4,698,100	年金定時払い			国庫短期証券発行償還
超過準備		4,698,100				(3M)
非準備先残高		674,100				
準備預金進捗率		99.9%				
平均		90.0%				
乖離率		9.9%				

### 10月12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)(10/13~)						
5~10年	0	0				
5~10年	0	0				
CP等買入(10/17~)	4,000	8,565	4,000	0.000	0.011	19.9
国債補充供給(10/12~10/13)	44,432	44,432	▲0.350	▲0.351		
	0	0				

マナリーベース [億円]	所要 [億円]
10月11日時点 6,644,100	今積期の所要準備額 3,887,300
	10月13日以降の残り所要
	積数 200
	平均 100

### 国庫短期証券入札予定

10月13日	3ヶ月(第1188回)
10月19日	1年(第1189回)
10月20日	3ヶ月
10月27日	3ヶ月
10月17日	20年
10月30日	2年
11月2日	10年
11月7日	物価連動

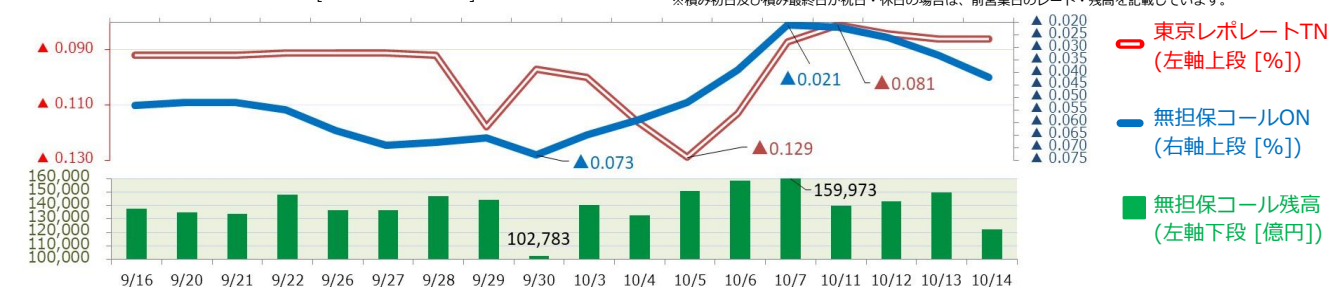
### 今月の国債買入オペ予定

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