



短期市場の推移

	10月6日	10月10日	10月11日	10月12日
加重平均金利	▲0.016	▲0.030	▲0.033	▲0.029
東京レポレート(TN)	▲0.103	▲0.107	▲0.109	▲0.146
無コール残	183,069	174,486	177,055	177,901
ON	109,651	101,238	104,007	104,953
その他	73,418	73,248	73,048	72,948
有コール残	26,746	27,222	27,888	28,374

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	▲0.019	▲0.101
T/N	-	-	▲0.025	▲0.122
S/N	-	-	▲0.005	-
1W	▲0.040	▲0.012	▲0.038	▲0.148
2W	▲0.040	0.005	▲0.032	▲0.166
3W	-	-	0.001	▲0.177
1M	▲0.020	▲0.007	▲0.014	▲0.188
2M	-	-	0.030	-
3M	0.004	0.028	0.018	▲0.199
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16日の予定 (時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
13:30	8月の鉱工業生産確報			
	-		-	
	-		-	

本日の市況

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▲0.030%~▲0.010%の水準で取引された。積み最終日の調整もあり取り手の調達意欲は旺盛で、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.010%の、▲0.019%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.020 ~ ▲0.015	~	▲0.030 ~ ▲0.010

翌営業日のマーケット

新積み期初日のため、ビッドサイドの様子見姿勢もあり、本対比低下を想定する。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	10月13日		10月16日		10月17日	
券	+400		+800		+0	
財政	+76,200		+900		+3,000	
過不足	+76,600		+1,700		+3,000	
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
CP等買入	▲200		▲100			+4,000
社債等買入	▲1,200					
E T F 買入		+700				
国債補完供給	+43,800	▲37,200	+37,200			
当座預金増減	+82,500		+38,800		+7,000	
当座預金残高	5,454,700		5,493,500		5,500,500	
準備預金残高	4,751,000		主な需給要因			
積み終了先	4,751,000		国庫短期証券発行償還(3M)			
超過準備	4,750,900					
非準備先残高	703,700					
準備預金進捗率	100.0%					
平均	100.0%					
乖離率	0.0%					

10月13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)(10/16~)						
5~10年	0	0				
5~10年	0	0				
国債補完供給(10/13~10/16)						
	37,795	37,795	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マネタリーベース [億円]

10月12日時点 6,626,300

所要

	来積期の所要準備額
10月16日以降の残り所要	4,006,500
積数	4,006,500
平均	129,200

国庫短期証券入札予定

10月19日	1年(第1189回)
10月20日	3ヶ月(第1190回)
10月27日	3ヶ月
11月2日	3ヶ月

国債入札予定

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

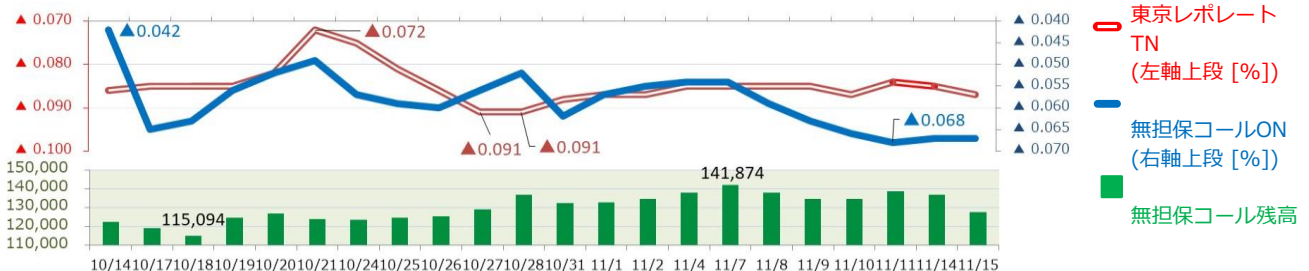
今月の国債買入オペ予定

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10月積み期 [10月14日~11月15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