



短期市場の推移

	10月10日	10月11日	10月12日	10月13日
加重平均金利	▲0.030	▲0.033	▲0.029	▲0.019
東京レボレート(TN)	▲0.107	▲0.109	▲0.146	▲0.122
無コール残	174,486	177,055	177,901	165,524
ON	101,238	104,007	104,953	95,876
その他	73,248	73,048	72,948	69,648
有コール残	27,222	27,888	28,374	27,607

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)			レボ市場
	最低	最高	平均	東京レボレート
O/N	▲0.087	0.001	▲0.028	▲0.097
T/N	-	-	-	▲0.119
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.045	0.010	▲0.026	▲0.145
2W	▲0.030	0.010	▲0.024	▲0.161
3W	-	-	-	▲0.169
1M	▲0.030	▲0.020	▲0.024	▲0.178
2M	-	-	-	-
3M	-	-	0.010	▲0.197
6M	-	-	-	▲0.127
1Y	-	-	-	▲0.086

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

10月17日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	22:15 (米) 鉱工業生産 (9月)	-
-	-	-	-
-	-	-	-

本日の市況

無担保コールON物は▲0.025%の出合から始まり、その後は主に▲0.040%~▲0.020%の水準で取引された。積み初日ではあるものの、ビッドサイドの調達意欲は底堅く、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.009%の、▲0.028%となった。

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

翌営業日のマーケット

引き続きビッドサイドの調達意欲は旺盛であり、本日対比上昇を予想する。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想
	10月16日	10月17日	10月17日	10月18日	10月18日
券	+800	+100	+100	▲1,000	
財政	▲800	+300	+300	▲10,000	
過不足	+0	+400	+400	▲11,000	
金融調節	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド
国債買入				+16,600	
CP等買入	▲100			+4,000	
国債補完供給	+37,200	▲35,700	+35,700		
当座預金増減	+1,400	+56,700	+56,700	▲11,000	
当座預金残高	5,456,100	5,512,800	5,512,800	5,501,800	
準備預金残高	4,755,100				主な需給要因
積み終了先	3,052,700				国債発行 (20年)
超過準備	1,336,800				
非準備先残高	701,000				
準備預金進捗率	85.3%				
平均	3.2%				
乖離率	82.1%				

10月16日のオペ結果

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)(10/17~)						
5~10年	0	0				
5~10年	0	0				
国債買入(10/17~)						
1~3年	4,250	11,428	4,253	▲0.003	▲0.002	69.9
3~5年	4,500	10,820	4,505	▲0.007	▲0.005	48.0
5~10年	6,750	11,484	6,756	▲0.014	▲0.011	9.4
25年~	1,000	2,748	1,006	0.011	0.011	67.4
国債補完供給(10/16~10/17)						
	36,260	36,260	▲0.350	▲0.351		
	0	0				

マネタリーベース

10月13日時点 6,708,300

所要

今積期の所要準備額	10月17日以降の残り所要	積数	平均
4,006,500		588,200	19,600

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
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

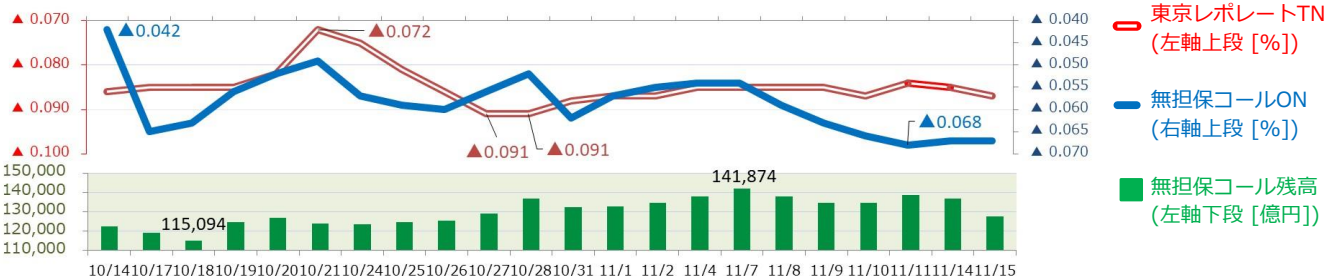
今月の国債買入オペ予定

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16日	1
3年超5年以下	4,000~7,500	4,500	4 16 23 27	10月16日	2
5年超10年以下	4,500~9,000	6,750	10 16 23 27	10月16日	2
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16日	1
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