



短期市場の推移

	10月11日	10月12日	10月13日	10月16日
加重平均金利	▲0.033	▲0.029	▲0.019	▲0.028
東京レボレート(TN)	▲0.109	▲0.146	▲0.122	▲0.119
無コール残	177,055	177,901	165,524	150,018
ON	104,007	104,953	95,876	84,185
その他	73,048	72,948	69,648	65,833
有コール残	27,888	28,374	27,607	28,443

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	▲0.015	▲0.096
T/N	-	-	-	▲0.107
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.030	▲0.018	▲0.027	▲0.147
2W	▲0.020	0.001	▲0.014	▲0.161
3W	-	-	-	▲0.169
1M	▲0.023	▲0.003	▲0.012	▲0.181
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.198
6M	-	-	-	▲0.127
1Y	-	-	-	▲0.087

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18日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	(米) 住宅着工件数 (9月)	-
-	-	-	-
-	-	-	-

本日の市況

無担保コールON物は▲0.015%の合出から始まり、その後は主に▲0.025%~▲0.005%の水準で取引された。引き続きビッドサイドの資金調達意欲は強く、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.013%の▲0.015%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.040 ~ ▲0.040	- ~ -	▲0.035 ~ ▲0.005

翌営業日のマーケット

引き続きビッドサイドの資金調達意欲は底堅く、合出の水準は本日対比横ばい圏を予想する。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	10月17日	10月18日	10月18日	10月19日	10月19日	10月19日
券		+100	▲400	▲1,000		
財政		+800	▲9,100	+5,000		
過不足		+900	▲9,500	+4,000		
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			
国債買入		+16,600				
CP等買入		+4,000	▲100			
社債等買入			▲300			
国債補充供給	+35,700	▲35,000	+35,000			
当座預金増減		+22,200	+26,100	+4,000		
当座預金残高		5,478,300	5,504,400	5,508,400		
準備預金残高		4,768,400			主な需給要因	
積み終了先		4,690,600	国債発行 (20年)			
超過準備		4,283,900				
非準備先残高		709,900				
準備預金進捗率		97.5%				
平均		6.5%				
乖離率		91.1%				

10月17日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
国庫短期証券買入(10/18~)	1,000	6,017	1,001	0.017	0.021	92.2
国債買入(固定利回り方式)(10/18~)						
5~10年		0	0			
5~10年		0	0			
米ドル資金供給(10/19~10/26)		3	3	5.580	5.580	
国債補充供給(10/17~10/18)		35,552	35,552	▲0.350	▲0.351	
		0	0			

マネタリーベース (億円)
 10月16日時点 6,708,900

所要	(億円)
今積期の所要準備額	4,006,500
10月18日以降の残り所要	
積数	99,200
平均	3,400

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

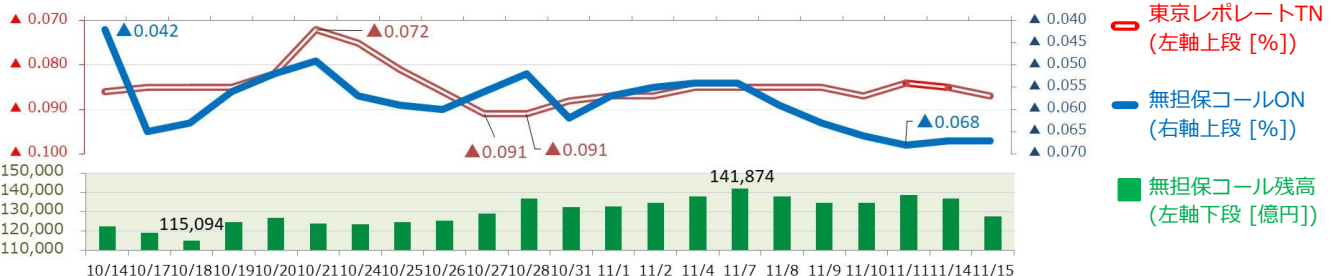
今月の国債買入オペ予定

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