



短期市場の推移

	10月12日	10月13日	10月16日	10月17日
加重平均金利	▲0.029	▲0.019	▲0.028	▲0.015
東京レポレート(TN)	▲0.146	▲0.122	▲0.119	▲0.107
無コール残	177,901	165,524	150,018	159,159
ON	104,953	95,876	84,185	94,561
その他	72,948	69,648	65,833	64,598
有コール残	28,374	27,607	28,443	28,266

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	▲0.080	0.001	▲0.011	▲0.096
T/N	-	-	-	▲0.105
S/N	-	-	▲0.020	-
1W	▲0.030	▲0.015	▲0.023	▲0.146
2W	▲0.020	▲0.005	▲0.015	▲0.162
3W	-	-	▲0.005	▲0.168
1M	-	-	-	▲0.177
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.197
6M	-	-	-	▲0.127
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19日の予定 (時刻は日本時間)

時刻	日本	予想	海外	予想
8:50	9月の貿易収支		(米)パウエルFRB議長の講演 (経済見通しについて)	
10:00	日銀支店長会議		(欧)8月の経常収支	
14:00	地域経済報告 (さくらレポート)		-	

本日の市況

無担保コールON物は▲0.008%の出合から始まり、その後は主に▲0.020%~▲0.008%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底堅く、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.004%の▲0.011%となった。本日、日本銀行は臨時の国債買入オペを実施した。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.010 ~ ▲0.010	- ~ -	▲0.035 ~ ▲0.008

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強く、出合の水準は本日対比横ばい圏を想定。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	10月18日	10月19日	10月19日	10月20日	10月20日	10月21日
券	▲400	▲1,000	▲1,000	▲1,000	▲1,000	▲1,000
財政	▲11,800	+8,800	+8,800	▲4,000	▲4,000	▲4,000
過不足	▲12,200	+7,800	+7,800	▲5,000	▲5,000	▲5,000
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			+3,900		
国債買入			▲300			
CP等買入	▲100		▲100			
社債等買入	▲300		▲100			
国債補充供給	+35,000	▲35,300	+35,300			
当座預金増減	▲11,900	+46,600	+46,600	▲5,000	▲5,000	▲5,000
当座預金残高	5,466,400	5,513,000	5,513,000	5,508,000	5,508,000	5,508,000
準備預金残高	4,762,200					
積み終了先	4,736,200					
超過準備	4,718,600					
非準備先残高	704,200					
準備預金進捗率	98.6%					
平均	9.7%					
乖離率	88.9%					

10月18日のオペ結果

オベ種類 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)(10/19~)	5~10年	3,000	9,092	3,010	0.026	0.028	63.9
5~10年	0	0					
5~10年	0	0					
国債買入(10/19~)	5~10年	3,000	9,092	3,010	0.026	0.028	63.9
10~25年	1,000	2,647	1,005	0.045	0.049	23.5	
国債補充供給(10/18~10/19)	35,862	35,862	▲0.350	▲0.351			
	0	0					

マネタリーベース [億円]	所要 [億円]
10月17日時点 6,731,000	今積期の所要準備額 4,006,500
	10月19日以降の残り所要積数 55,600
	平均 2,000

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30日	2年
11月2日	10年
11月7日	物価連動
11月9日	30年

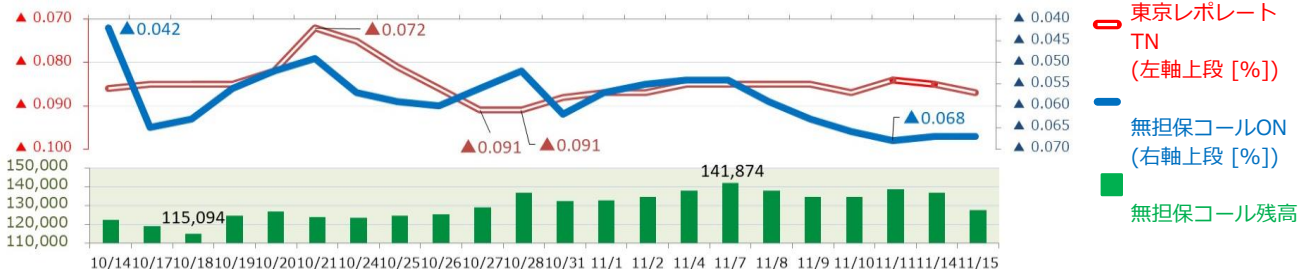
今月の国債買入オペ予定

オベ種類	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	3,000	10 16 23 27	10月18日	2
10年超25年以下	1,000~5,000	1,000	4 10 23 27	10月18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