



短期市場の推移

	10月13日	10月16日	10月17日	10月18日
加重平均金利	▲0.019	▲0.028	▲0.015	▲0.011
東京レボレート(TN)	▲0.122	▲0.119	▲0.107	▲0.105
無コール残	165,524	150,018	159,159	160,274
ON	95,876	84,185	94,561	93,027
その他	69,648	65,833	64,598	67,247
有コール残	27,607	28,443	28,266	28,289

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	▲0.080	0.001	▲0.010	▲0.096
T/N	-	-	-	▲0.100
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.040	0.030	▲0.022	▲0.140
2W	▲0.040	▲0.015	▲0.036	▲0.157
3W	-	-	-	▲0.166
1M	▲0.005	0.011	0.008	▲0.174
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.197
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20日の予定 (時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
8:30	全国CPI (9月)		-	
	-		-	
	-		-	

本日の市況

無担保コールON物は▲0.008%の合出から始まり、その後は主に▲0.015%~▲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旺盛であり、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.001%の▲0.010%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.010 ~ ▲0.010	- ~ -	▲0.040 ~ ▲0.005

翌営業日のマーケット

週末3日積みでビッドサイドの調達意欲の一層の強まりが想定され、合出の水準は本日対比上昇すると予想。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	10月19日	10月20日	10月20日	10月23日	10月23日	10月23日
券		▲900	▲100			+0
財政		+8,600	▲7,300			+5,000
過不足		+7,700	▲7,400			+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
国債買入		+3,900				
CP等買入	▲300		▲200			
社債等買入	▲100		▲1,600			
国債補充供給	+35,300	▲37,800	+37,800			
当座預金増減		+8,700	+28,600			+5,000
当座預金残高		5,475,100	5,503,700			5,508,700
準備預金残高		4,790,000				主な需給要因
積み終了先		4,781,800				
超過準備		4,776,100				
非準備先残高		685,100				国庫短期証券発行・償還 (1Y)
準備預金進捗率		99.0%				国庫短期証券発行・償還 (3M)
平均		12.9%				
乖離率		86.1%				

10月19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)(10/20~)						
5~10年	0	0				
5~10年	0	0				
社債等買入(10/24~)						
	1,000	2,607	1,001	0.358	0.369	33.3
国債補充供給(10/19~10/20)						
	38,485	38,485	▲0.350	▲0.351		
	0	0				

マネタリーベース

10月18日時点 6,719,400

所要

今積期の所要準備額	10月20日以降の残り所要
4,006,500	積数 41,700
	平均 1,500

国庫短期証券入札予定

10月20日	3ヶ月(第1190回)
10月27日	3ヶ月
11月2日	3ヶ月
11月9日	6ヶ月
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

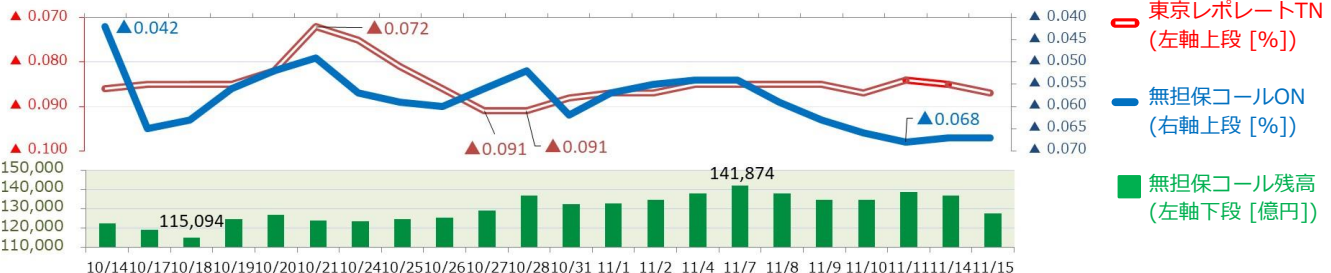
今月の国債買入オペ予定

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	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