



短期市場の推移

	10月16日	10月17日	10月18日	10月19日
加重平均金利	▲0.028	▲0.015	▲0.011	▲0.010
東京レボレート(TN)	▲0.119	▲0.107	▲0.105	▲0.100
無コール残	150,018	159,159	160,274	149,632
ON	84,185	94,561	93,027	81,185
その他	65,833	64,598	67,247	68,447
有コール残	28,443	28,266	28,289	27,530

[億円] [%]

10月23日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想

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	▲0.085	▲0.003	▲0.010	▲0.094
T/N	-	-	-	▲0.095
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.013	▲0.010	▲0.012	▲0.131
2W	▲0.030	▲0.015	▲0.020	▲0.152
3W	-	-	-	▲0.160
1M	-	-	-	▲0.168
2M	-	-	0.001	-
3M	-	-	-	▲0.196
6M	-	-	-	▲0.125
1Y	-	-	-	▲0.087

本日の市況

無担保コールON物は▲0.005%の出合から始まり、その後は主に▲0.015~▲0.005%の水準で取引された。週末3日積みであることから調達ニーズは底堅く、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比横ばいの▲0.010%となった。また本日、日銀は貸付期間5年の共通担保資金供給オペを24日に実施することを通知した。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.010 ~ ▲0.010	- ~ -	▲0.040 ~ ▲0.003

翌営業日のマーケット

堅調な地合いを予想する。

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

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	10月20日	10月21日	10月23日	10月24日	10月24日	10月25日
券		▲100	+100			+0
財政		▲6,700	+8,700			▲1,000
過不足		▲6,800	+8,800			▲1,000
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		▲300			
社債等買入	▲1,600					
国債補完供給	+37,800	▲34,100	+34,100			
当座預金増減		▲4,900	+42,600			▲1,000
当座預金残高		5,470,200	5,512,800			5,511,800
準備預金残高		4,791,200				主な需給要因
積み終了先		4,786,900				国庫短期証券発行・償還(3M)
超過準備		4,785,800				
非準備先残高		679,000				
準備預金進捗率		99.4%				
平均		22.6%				
乖離率		76.8%				

10月20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)(10/23~)						
5~10年	0	0				
5~10年	0	0				
国債補完供給(10/20~10/23)						
	34,765	34,765	▲0.350	▲0.351		
	50	50	▲0.350	▲0.350		

マナタリーベース [億円]	所要 [億円]
10月19日時点 6,729,100	今積期の所要準備額 4,006,500
	10月23日以降の残り所要 積数 25,600
	平均 1,100

国庫短期証券入札予定

10月27日	3ヶ月(第1191回)
11月2日	3ヶ月
11月9日	6ヶ月
11月10日	3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

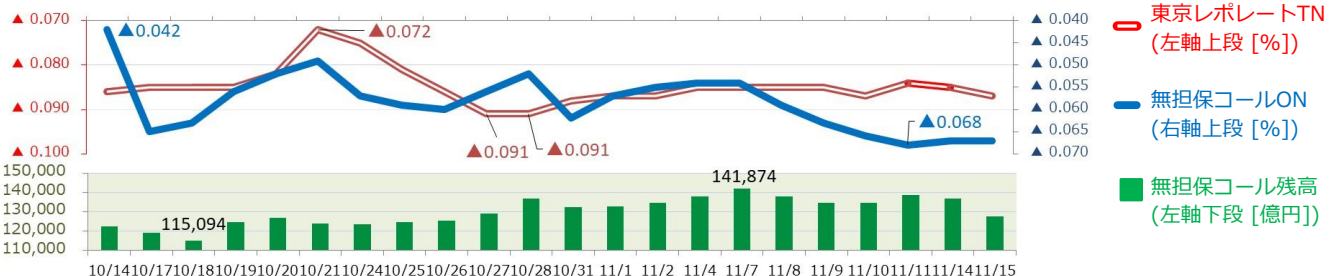
今月の国債買入オペ予定

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