



<来週の資金需給予想とイベント予定>

(単位: 億円)

日付	資金需給予想			主要要因	オペ期日	オペスタート	イベント
	銀行券要因	財政等要因	資金過不足				
10/6 (月)	+ 700	+ 900	+ 1,600	国庫短期証券発行償還 (3M)	国債補完供給 1,300		日: 日銀支店長会議 : 地域経済報告 (さくらリポート) (10月) 公表
10/7 (火)	トン	▲ 3,000	▲ 3,000				米: 貿易収支 (8月)
10/8 (水)	トン	▲ 13,000	▲ 13,000	国債発行 (30年)			日: 植田日銀総裁がパリ・ユーロプラス主催のフォーラムで講演 米: FOMC議事要旨 (9月16、17日開催分)
10/9 (木)	▲ 1,000	+ 3,000	+ 2,000				米: 新規失業保険申請件数 (10月4日終了週)
10/10 (金)	トン	▲ 26,000	▲ 26,000	国庫短期証券発行償還 (6M) 国債発行 (5年)			日: 国内企業物価指数 (前年比) (9月) : 国内企業物価指数 (前月比) (9月) 米: 財政収支 (9月)

<インターバンク>

日銀当座預金残高は週初、前営業日対比7,300億円減少し、503兆2,100億円から始まった。その後、国債発行や法人税・消費税・保険揚げ等の要因により減少し、10月3日は492兆4,700億円 (速報) で越えた。無担保コールON物加重平均金利は週初、0.477%から始まり、その後も横ばい圏で推移した。ターム物は1W~3W物0.470%~0.610%のレンジ、1M~3M物0.535~0.70%のレンジで出合が見られた。来週の予定は、国内では、10月6日に日銀支店長会議、地域経済報告 (さくらリポート、10月) の公表、海外では7日に米貿易収支 (8月)、8日にFOMC議事要旨 (9月16、17日分) の公表などがある。

[無担保コールレート]

	予想レンジ (%)
O/N	0.450 ~ 0.478
1M	0.55 ~ 0.65
2M	0.60 ~ 0.65
3M	0.64 ~ 0.75
6M	0.75 ~ 0.90

<レボ>

足許GCは週初、取引が月末を跨ぐこともあり、レートは低下。0.30%台半ば~後半で取引された。以降は週末まで+0.49%~+0.50%の狭いレンジで取引が続いた。

SC取引は2年470~476回債、5年155~179回債、10年355~371、378~379回債、20年110~130回債などに引合いが見られた。

[オープン市場]

	予想レンジ (%)
現先 (on/1w)	0.40%台
CP 3M	0.55 ~ 0.65

<CP>

今週の入札発行総額は約1兆2,268億円で、週間償還額の3,140億円を大幅に上回った。期末の有利子負債圧縮に徹していた企業が調達を再開したことから、発行超となった。発行残高は、先週末時点の24兆3,549億円から、10月2日時点で22兆5,998億円へと減少した。発行市場では、不動産業・電気業・建設業をはじめとする幅広い業種で大型の発行案件が見られた。入札案件の発行レートは、a-1格相当の1か月物で0.50%台、3か月物で0.60%台を中心に、幅広い水準での取引が確認された。

来週の償還額は1兆400億円となっている。発行市場は、期明けに伴う企業の底堅い調達意欲により、相応の発行が見込まれる。発行レートについては、政策金利の引き上げに対する警戒感が高まっており、引き続き水準を見極める展開が予想される。

<TDB>

10月3日の3M (1335回債) の入札は、最高落札利回り0.5335% (前回債0.4915%)、平均落札利回り0.5039% (前回債0.4582%) となった。来週の入札は9日に6M、10日に3Mが予定されている。

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。