



短期市場の推移

	10月17日	10月18日	10月19日	10月20日
加重平均金利	▲0.015	▲0.011	▲0.010	▲0.010
東京レボレート(TN)	▲0.107	▲0.105	▲0.100	▲0.095
無コール残	159,159	160,274	149,632	150,250
ON	94,561	93,027	81,185	81,703
その他	64,598	67,247	68,447	68,547
有コール残	28,266	28,289	27,530	27,606

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	▲0.080	0.001	▲0.012	▲0.098
T/N	-	-	-	▲0.100
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.040	▲0.010	▲0.020	▲0.130
2W	▲0.020	0.005	▲0.017	▲0.151
3W	-	-	-	▲0.159
1M	-	-	-	▲0.168
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.193
6M	-	-	-	▲0.116
1Y	-	-	-	▲0.082

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24日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	(米) 10月の製造業PMI (速報)	-
-	-	-	-
-	-	-	-

本日の市況

無担保コールON物は▲0.010%の出合から始まり、その後は主に▲0.020%~▲0.005%の水準で取引された。三日積み要因は剥落したものの、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▲0.002%の▲0.012%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.010 ~ ▲0.010	- ~ -	▲0.020 ~ ▲0.005

翌営業日のマーケット

オファー・ビッドの動向に大きな変化はなく、出合水準は横ばい圏を想定。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	10月23日	10月24日	10月24日	10月25日	10月25日	10月26日
券	+100	▲200	▲200	▲200	+0	+0
財政	+10,400	+3,800	+3,800	+3,800	▲1,000	▲1,000
過不足	+10,500	+3,600	+3,600	+3,600	▲1,000	▲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
国債買入				+17,600		
共通担保(全店)					▲6,400	
CP等買入	▲300		▲400			
社債等買入				+1,000		
国債補充供給	+34,100	▲33,200	+33,200			
当座預金増減	+11,100	+55,000	+55,000	+55,000	▲7,400	▲7,400
当座預金残高	5,481,300	5,536,300	5,536,300	5,536,300	5,528,900	5,528,900
準備預金残高	4,791,400					
積み終了先	4,788,800					
超過準備	4,788,300					
非準備先残高	689,900					
準備預金進捗率	99.4%					
平均	25.8%					
乖離率	73.6%					

10月23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)(10/24~)						
5~10年	0	0				
5~10年	0	0				
国債買入(10/24~)						
1~3年	4,250	11,523	4,254	0.007	0.009	94.1
3~5年	4,500	11,708	4,506	0.006	0.008	27.1
5~10年	6,750	13,908	6,757	0.010	0.012	60.4
10~25年	2,000	4,753	2,004	0.030	0.033	58.0
国債補充供給(10/23~10/24)						
	33,857	33,857	▲0.350	▲0.351		
	0	0				

マネタリーベース

10月20日時点 6,724,300 [億円]

所要

今積期の所要準備額	10月24日以降の残り所要	積数	平均
4,006,500		22,500	1,000

国債短期証券入札予定

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

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

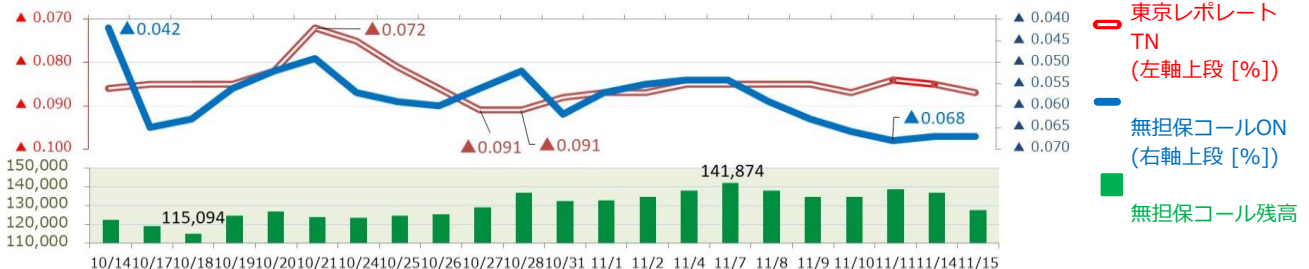
今月の国債買入オペ予定

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23日	0
3年超5年以下	4,000~7,500	4,500	4 16 23 27	10月23日	1
5年超10年以下	4,500~9,000	6,750	10 16 23 27	10月23日	1
10年超25年以下	1,000~5,000	2,000	4 10 23 27	10月23日	1
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