



### 短期市場の推移

	10月18日	10月19日	10月20日	10月23日
加重平均金利	▲0.011	▲0.010	▲0.010	▲0.012
東京レボレート(TN)	▲0.105	▲0.100	▲0.095	▲0.100
無コール残	160,274	149,632	150,250	152,074
ON	93,027	81,185	81,703	82,187
その他	67,247	68,447	68,547	69,887
有コール残	28,289	27,530	27,606	27,683

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	▲0.087	0.001	▲0.014	▲0.099
T/N	-	-	-	▲0.099
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.028	▲0.003	▲0.020	▲0.136
2W	-	-	▲0.025	▲0.152
3W	▲0.010	0.001	▲0.006	▲0.161
1M	-	-	-	▲0.169
2M	-	-	-	-
3M	-	-	0.030	▲0.192
6M	-	-	-	▲0.115
1Y	-	-	-	▲0.081

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25日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	(米)パウエルFRB議長、あいさつ	-
-	-	-	-
-	-	-	-

### 本日の市況

無担保コールON物は▲0.010%の合から始まり、その後は主に▲0.020%~▲0.008%の水準で取引された。ビッドサイドの調達意欲は減退し、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.002%の▲0.014%となった。

都銀・信託	証券	地銀
- ~ -	▲0.015 ~ ▲0.015	▲0.023 ~ ▲0.005

### 翌営業日のマーケット

ビッドサイドの資金調達意欲はやや減退し、地合いは本日対比低下すると予想。

### 資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	10月24日	10月25日	10月24日	10月25日	10月24日	10月25日
券						
財政	▲300	▲100	▲300	▲100	▲1,000	▲2,000
過不足	+300	+5,200	+300	+5,200	+3,000	+3,000
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						
国債買入		+17,600		+3,900		+1,000
共通担保(全店)			▲6,400	▲17,100		
CP等買入	▲400		▲500			
社債等買入		+1,000	▲600			
国債補完供給	+33,200	▲34,700	+34,700			
当座預金増減		+17,000		+54,400		▲3,000
当座預金残高		5,498,300		5,552,700		5,549,700
準備預金残高		4,813,100				
積み終了先		4,810,600				
超過準備		4,810,600				
非準備先残高		685,200				
準備預金進捗率		99.5%				
平均		29.0%				
乖離率		70.5%				

### 10月24日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
国庫短期証券買入(10/25~)	1,000	5,710	1,003	0.020	0.020	81.1
国債買入(固定利回り方式)(10/25~)						
5~10年	0	0				
5~10年	0	0				
国債買入(10/25~)						
5~10年	3,000	8,639	3,001	▲0.012	▲0.010	40.1
10~25年	1,000	2,605	1,005	▲0.009	▲0.006	5.7
米ドル資金供給(10/26~11/2)						
	0	0	5,580	5.580		
国債補完供給(10/24~10/25)						
	35,441	35,441	▲0.350	▲0.351		
	0	0				
共通担保(全店)(10/25~11/8)						
	7,061	7,061				
共通担保(全店)(2023/10/25~2028/10/25)						
	10,000	35,130	10,003	0.320	0.338	27.9

### マネタリーベース

10月23日時点 6,735,300

### 所要

今積期の所要準備額	10月25日以降の残り所要
4,006,500	
積数	20,100
平均	900

### 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

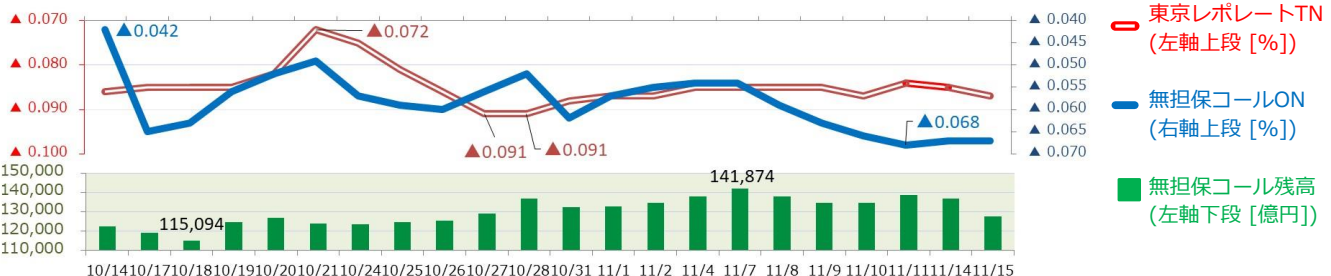
### 今月の国債買入オペ予定

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	3,000	10 16 23 27	10月24日	1
10年超25年以下	1,000~5,000	1,000	4 10 23 27	10月24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