



### 短期市場の推移

	10月23日	10月24日	10月25日	10月26日
加重平均金利	▲0.012	▲0.014	▲0.018	▲0.019
東京レボレート(TN)	▲0.100	▲0.099	▲0.101	▲0.119
無コール残	152,074	151,121	150,159	153,919
ON	82,187	81,634	78,452	82,212
その他	69,887	69,487	71,707	71,707
有コール残	27,683	27,448	28,380	27,906

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	▲0.005	▲0.013	▲0.110
T/N	-	-	-	▲0.120
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.020	▲0.015	▲0.016	▲0.145
2W	-	-	-	▲0.155
3W	-	-	0.001	▲0.160
1M	-	-	0.180	▲0.168
2M	-	-	-	-
3M	0.001	0.030	0.024	▲0.189
6M	-	-	-	▲0.118
1Y	-	-	-	▲0.084

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30日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
日銀金融政策決定会合 (31日まで)			

### 本日の市況

無担保コールON物は▲0.013%の出合から始まり、その後は主に▲0.018%~▲0.008%の水準で取引された。週末要因の影響もあり取り手の調達意欲が旺盛に見られ、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.006%の▲0.013%となった。

都銀・信託	証券	地銀
- ~ -	- ~ -	▲0.018 ~ ▲0.008

### 翌営業日のマーケット

週末要因の剥落もあり、調達目線の低下が想定され、出合水準は低下を想定。

### 資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	10月27日	10月30日	10月30日	10月31日	10月31日	10月31日
券	▲400	+200		▲500		
財政	▲700	+10,800		+400		
過不足	▲1,100	+11,000		▲100		
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				+14,800		
CP等買入	▲300	▲400				+4,000
国債補完供給	+38,200	+45,400	+45,400			
当座預金増減	▲8,600	+70,800		+3,900		
当座預金残高	5,504,000	5,574,800		5,578,700		
準備預金残高	4,808,200					主な需給要因
積み終了先	4,806,900					国庫短期証券発行・償還 (3M)
超過準備	4,806,800					
非準備先残高	695,800					
準備預金進捗率		99.7%				
平均		45.2%				
乖離率		54.6%				

### 10月27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)(10/30~)						
5~10年	0	0				
5~10年	0	0				
国債買入(10/30~)						
3~5年	4,500	8,675	4,505	▲0.004	▲0.001	22.1
5~10年	6,750	11,243	6,759	▲0.014	▲0.011	64.0
10~25年	2,000	3,676	2,003	0.001	0.006	59.1
25年~	1,000	1,684	1,001	▲0.015	▲0.014	34.5
物価連動	600	1,344	602	▲0.010	▲0.056	84.6
国債補完供給(10/27~10/30)						
	46,411	46,411	▲0.350	▲0.356		
	0	0				

### マネタリーベース

10月26日時点 6,768,300

### 所要

今積期の所要準備額	4,006,500
10月30日以降の残り所要	
積数	10,700
平均	600

### 国庫短期証券入札予定

11月2日	3ヶ月(第1192回)
11月9日	6ヶ月
11月10日	3ヶ月
11月16日	1年

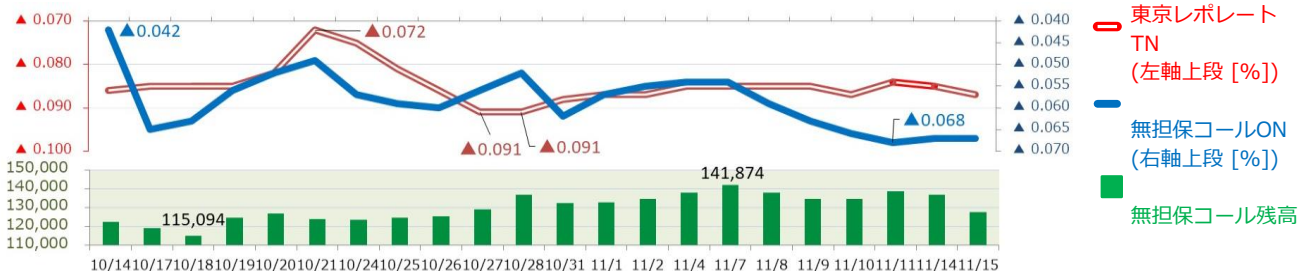
### 今月の国債買入オペ予定

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27日	0
5年超10年以下	4,500~9,000	6,750	10 16 23 27	10月27日	0
10年超25年以下	1,000~5,000	2,000	4 10 23 27	10月27日	0
25年超	500~3,500	1,000	10 16 27	10月27日	0
物価連動債	600	600	月1回	10月27日	0
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