



短期市場の推移

	10月25日	10月26日	10月27日	10月30日
加重平均金利	▲0.018	▲0.019	▲0.013	▲0.016
東京レポレート(TN)	▲0.101	▲0.119	▲0.120	▲0.181
無コール残	150,159	153,919	156,534	157,667
ON	78,452	82,212	84,687	87,055
その他	71,707	71,707	71,847	70,612
有コール残	28,380	27,906	27,505	26,205

加重平均金利・コール残高は日銀、東京レポ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)			レポ市場
	最低	最高	平均	東京レポレート
O/N	▲0.087	0.001	▲0.020	▲0.270
T/N	-	-	-	▲0.179
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.025	▲0.015	▲0.022	▲0.169
2W	-	-	-	▲0.169
3W	-	-	▲0.015	▲0.169
1M	▲0.001	0.000	▲0.001	▲0.183
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.192
6M	-	-	-	▲0.118
1Y	-	-	-	▲0.084

無担保コール(速報)は日銀、東京レポレートは日本証券業協会公表

11月1日の予定 (時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
14:00	経済・物価情勢の展望(全文)		3:00	(米) FOMC 結果	
				パウエルFRB議長の会見	
				(米) 10月の製造業PMI(確報)	

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▲0.020%~▲0.012%の水準で取引された。月末であったが、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▲0.004%の▲0.020%となった。また、日本銀行は本日開催の金融政策決定会合にて、YCCの運用のさらなる柔軟化を決定した。

都銀・信託	証券	地銀
- ~ -	- ~ -	▲0.020 ~ ▲0.012

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31日	11月1日	11月1日	11月2日	11月2日	11月2日
券	+0		▲900		▲1,000	
財政	▲3,000		▲29,100		▲9,000	
過不足	▲3,000		▲30,000		▲10,000	
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	▲1,800	+4,000	▲200			
社債等買入	▲100					
国債補完供給	+47,400	▲53,000	+53,000			
当座預金増減	▲6,500		+22,800		▲10,000	
当座預金残高	5,517,100		5,539,900		5,529,900	
準備預金残高	4,803,400		主な需給要因			
積み終了先	4,802,400		国債発行(2年)		税・保険揚げ	
超過準備	4,802,300				地方交付税交付金	
非準備先残高	713,700					
準備預金進捗率	99.8%					
平均	51.6%					
乖離率	48.2%					

10月31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)(11/1~)						
5~10年	0	0				
5~10年	0	0				
米ドル資金供給(11/2~11/9)						
	0	0	5,580	5,580		
国債補完供給(10/31~11/1)						
	54,127	54,127	▲0.450	▲0.450		
	0	0				

マネタリーベース

10月30日時点 6,779,400

所要

今積期の所要準備額	4,006,500
11月1日以降の残り所要	
積数	8,400
平均	600

国債短期証券入札予定

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

来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	1
1年超3年以下	3,500~6,500	4,250	6 10 15 22	10月23日	4
3年超5年以下	4,000~7,500	4,500	6 10 22 29	10月27日	4
5年超10年以下	4,500~9,000	6,750	6 15 22 29	10月27日	4
10年超25年以下	1,000~5,000	2,000	6 10 15 29	10月27日	4
25年超	500~3,500	1,000	6 15 22	10月27日	3
物価連動債	600	600	月1回	10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