



短期市場の推移

	10月23日	10月24日	10月25日	10月28日
加重平均金利	0.227	0.227	0.227	0.228
東京レポレート(TN)	0.235	0.230	0.239	0.236
無コール残	73,026	73,201	75,127	76,044
ON	25,776	25,801	27,052	28,249
その他	47,250	47,400	48,075	47,795
有コール残	37,693	38,230	37,317	36,651

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	0.220	0.275	0.228	0.137
T/N	-	-	0.213	0.183
S/N	-	-	-	-
1W	0.231	0.390	0.288	0.203
2W	-	-	0.290	0.203
3W	-	-	-	0.203
1M	-	-	-	0.205
2M	-	-	-	-
3M	-	-	0.350	0.213
6M	-	-	-	0.276
1Y	-	-	-	0.330

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

10月30日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	(米) ADP雇用統計 (10月)	-
-	-	(米) GDP (7~9月・速報)	-
-	-	(欧) ユーロ圏GDP (7~9月・速報)	-

本日の市況

無担保コールON物は0.227%の出合から始まり、その後は主に0.226%~0.227%を中心に取引された。一部金融機関による試し取りに加え、ビッドサイドの資金調達意欲は引き続き底堅く、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比横ばいの0.228%となった。

都銀・信託	証券	地銀
- ~ -	0.227 ~ 0.227	0.226 ~ 0.227

翌営業日のマーケット

ビッドサイドの資金調達意欲は引き続き旺盛であるため、出合の水準は本日対比横ばい圏を予想する。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	10月29日	10月30日	10月30日	10月31日	10月31日	10月31日
券	▲100	▲300	▲300	▲300	▲300	▲300
財政	▲6,900	▲900	▲900	▲1,700	▲1,700	▲1,700
過不足	▲7,000	▲1,200	▲1,200	▲2,000	▲2,000	▲2,000
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		+8,900				
共通担保(全店)			▲8,000	+8,000		
CP等買入	▲200					+4,000
国債補完供給	+6,600	▲8,800	+8,800			
当座預金増減	▲500		+7,600		+2,000	
当座預金残高	5,487,500		5,495,100		5,497,100	
準備預金残高	4,908,800		主な需給要因			
積み終了先	4,908,300					
超過準備	4,908,300					
非準備先残高	578,700					
準備預金進捗率	99.9%					
平均	45.2%					
乖離率	54.7%					

10月29日のオペ結果

[%][億円] ※米ドル資金供給は百万\$

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
米ドル資金供給(10/31~11/7)	1	1	5,080	5,080		
国債補完供給(10/29~10/30)	9,000	9,000	▲0.050	▲0.050		
共通担保(全店)(10/30~11/13)	1	1	▲0.050	▲0.050		
共通担保(全店)(10/30~11/13)	8,000	13,232	8,007		60.5	

マネタリーベース [億円]
 10月28日時点 6,730,900

所要	[億円]
今積期の所要準備額	4,041,000
10月30日以降の残り所要	
積数	5,500
平均	300

国債短期証券入札予定

11月1日	3ヶ月(第1266回)
11月7日	6ヶ月
11月8日	3ヶ月
11月15日	3ヶ月

国債入札予定

11月7日	10年
11月11日	物価連動
11月13日	30年
11月15日	5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	2		10月2日 0
1年超3年以下	3250	3,250	2 7 11 18		10月18日 0
3年超5年以下	3250	3,250	2 7 18 28		10月28日 0
5年超10年以下	3750	3,750	7 11 18 28		10月28日 0
10年超25年以下	1500	1,500	7 11 28		10月28日 0
25年超	750	750	2 18		10月28日 0
物価連動債	600	600	28		10月28日 0
変動利付債	-	300	-		2023/4/14 -

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