## 上田八木短資

## 0

## デイリーシグナル

2022年11月9日(水)

短期市場の推移 [億円][%					
		11月2日	11月4日	11月7日	11月8日
	巨平均金利	▲0.055	▲0.054	▲0.054	▲0.059
1	東京レボ ート(TN)	▲0.087	▲0.085	▲0.085	▲0.085
無	コール残	134,727	138,052	141,874	138,043
	ON	72,790	74,865	79,667	75,736
	その他	61,937	63,187	62,207	62,307
有コール残		30,844	31,195	31,372	29,400

11月10日の予定 (時刻は日本時間)

	日本		予想	海外		予想	
5	8:50	10月国内企業物価指数 [前年比]	+8.8%	22:30	(米)新規失業保険申請件数 [前週分]	-	
		-		22:30	(米)10月消費者物価コア指数 [前年比]	6.6%	
		-			-		

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 [%]

経済指標及び予想値は株式会社フィスコ提供

*ロの/亞州川-物立州 [70]						
	無担	レポ市場				
	最低 最高 平均		東京レポ			
				レート		
O/N	▲0.080	0.001	▲0.063	▲0.085		
T/N	-	-	-	▲0.085		
S/N	-	-	1	-		
1W	-	-	▲0.063	▲0.089		
2W	-	-	-	▲0.093		
3W	-	-	-	▲0.101		
1M	-	-	-	▲0.110		
2M	-	-	-	-		
3M	-	-	0.020	▲0.128		
6M	-	-	-	▲0.138		

本日の無担保コールON物は $\blacktriangle$ 0.065%の出合から始まり、その後は主に $\blacktriangle$ 0.070% $\sim$  $\blacktriangle$ 0.060% の水準で取引された。地銀業態を中心に調達ニーズの減退がみられ、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比 $\blacktriangle$ 0.004%の $\blacktriangle$ 0.063%となった。

 都銀・信託
 証券
 地銀

 ▲ 0.070 ~ ▲ 0.065
 ▲ 0.065 ~ ▲ 0.060
 ▲ 0.070 ~ ▲ 0.060

翌営業日のマーケット

本日の市況

調達ニーズは一層弱まり、出合の水準は本日対比低下と予想。

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
-------------------	----------------

資金需給

[億円] 11月9日のオベ結果 [%][億円]※米ドル資金供給は百万\$ 予想 オペ種類 オファー 応札 落札 足切 平均 按分

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	11月9日		11月10日		11月11日	
券	+700		<b>▲</b> 500		<b>▲</b> 1,000	
財政		+200	<b>▲</b> 17,600		+2,000	
過不足		+900	<b>▲</b> 18,100		+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
国庫短期証券買入		+1,000				
国債買入		+18,000				
共通担保(全店)	<b>▲</b> 10,300	+5,800				
CP等買入	▲100		<b>▲100</b>			
国債補完供給	+12,500	<b>▲</b> 12,900	+12,900			
当座預金増減	+14,900		<b>▲</b> 5,300		+1,000	
当座預金残高	4,921,200		4,915,900		4,916,900	
準備預金残高	4,294,200		主な需		給要因	
積み終了先	4,294,100					
±刀、瓜、件 /芒		4 204 400				

627,000

99.9%

80.6%

▲0.132

国債発行(30年)

国庫短期証券発行・償還

(6M)

国債買入(固定利回り方式)(11/10~)
5~10年 0 0
5~10年 0 0
国債補完供給(11/9~11/10)
12,870 12,870 ▲0.350 ▲0.350
0 0

 マネタリーベース [億円]

 11月8日時点 6,161,900

	所要	[18円]
1	今積期の所要準備額	3,871,400
	11月10日以降の残り所要	
	積数	300
l	平均	100

r/ema

国庫短期証券入札予定				
11月11日	3ヶ月(第1120回)			
11月17日	1年			
11月18日	3ヶ月			
11月25日	3ヶ月			
国債入札予定				
11月15日	5年			
11月17日	20年			
11月25日	40年			
11月29日	2年			

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。

非準預先残高

準備預金進捗率

平均

今月の国債買入オペ予定					[1思円]
オペ種類	一回当たりオファー金額	直近オファー額	直近オファー額 オファー予定日		残り回数
1年以下	1500	1,500	月1回	11月2日	0
1年超3年以下	4750	4,750	2 8 14 21	11月8日	2
3年超5年以下	4750	4,750	2 8 21 28	11月8日	2
5年超10年以下	5500	5,500	<b>8</b> 14 21 28	11月8日	3
10年超25年以下	2500	2,500	8 21 28	11月8日	2
25年超	1000	1,000	2 14 28	11月2日	2
物価連動債	600	600	月1回	10月21日	1
変動利付債<四半期>	300	300	四半期に1回	10月17日	0
		•			

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

1年前の市場推移 ○2021年10月積み期 [10月15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。 ▲ 0.080 ▲ 0.020 東京レポレートTN ▲ 0.025 ▲ 0.030 (左軸上段 [%]) ▲0.085 -▲ 0.035 ▲ 0.100 ▲0.051 ▲ 0.040 ▲0.026 ▲ 0.045 無担保コールON ▲0.111 ▲ 0.050 ▲ 0.055 (右軸上段 [%]) ▲ 0.120 178,692 無担保コール残高 135,176 (左軸下段 [億円]) 10/21 10/25 10/27 10/29 11/9 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、