



短期市場の推移

	10月26日	10月27日	10月30日	10月31日
加重平均金利	▲0.019	▲0.013	▲0.016	▲0.020
東京レボレート(TN)	▲0.119	▲0.120	▲0.181	▲0.179
無コール残	153,919	156,534	157,667	173,513
ON	82,212	84,687	87,055	107,111
その他	71,707	71,847	70,612	66,402
有コール残	27,906	27,505	26,205	24,637

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	▲0.016	▲0.103
T/N	-	-	▲0.020	▲0.140
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.030	▲0.015	▲0.026	▲0.158
2W	▲0.020	0.030	▲0.011	▲0.163
3W	-	-	-	▲0.169
1M	▲0.010	0.020	0.002	▲0.175
2M	-	-	-	-
3M	-	-	0.028	▲0.187
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

11月2日の予定 (時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
15:00	財政資金対民間収支 (10月)		(米) 新規失業保険申請件数 (週間)	

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%~▲0.010%の水準で取引された。11月に入り、ビッドサイドの資金調達意欲は一層強まり、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.004%の▲0.016%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.030 ~ ▲0.030	▲0.015 ~ ▲0.015	▲0.020 ~ ▲0.010

翌営業日のマーケット

週末4日積みのため、ビッドサイドの調達意欲がさらに旺盛になることが想定され、出合い水準は前営業日対比上昇すると予想。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想
	11月1日	11月2日	11月2日	11月6日	11月6日
券		▲900	▲500		+1,000
財政		▲33,500	▲2,600		▲25,000
過不足		▲34,400	▲3,100		▲24,000
金融調節	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド
国債買入				+4,000	
CP等買入	▲200		▲200		
国債補完供給	+53,000	▲36,900	+36,900		
当座預金増減		▲18,500	+37,600		▲24,000
当座預金残高		5,498,600	5,536,200		5,512,200
準備預金残高		4,794,100			
積み終了先		4,793,100			
超過準備		4,793,100			
非準備先残高		704,500			
準備預金進捗率		99.8%			
平均		54.8%			
乖離率		45.0%			

11月1日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
国債補完供給(11/1~11/2)	37,938	37,938	▲0.450	▲0.451		
国債買入(11/2~)	3~5年	1,000	4,229	1,003	0.020	0.023 24.7
	5~10年	3,000	7,777	3,009	0.013	0.016 18.9

マナタリーベース (億円)
 10月31日時点 6,773,000

所要	所要
今積期の所要準備額	4,006,500
11月2日以降の残り所要	
積数	7,400
平均	500

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

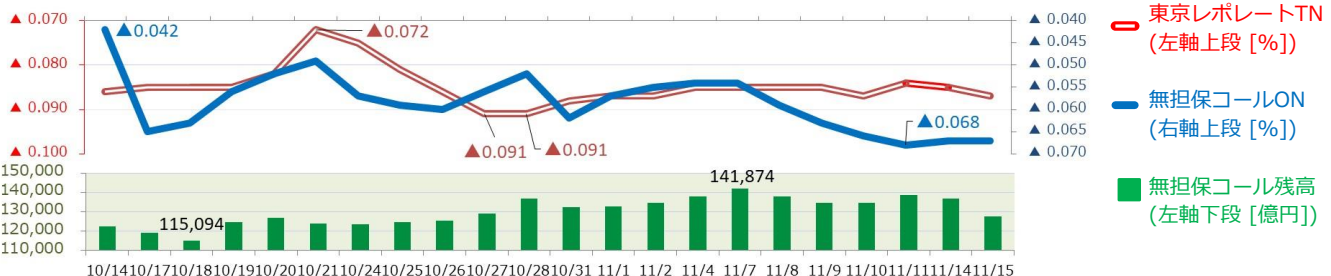
今月の国債買入オペ予定

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	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	1,000	6 10 22 29	11月1日	4
5年超10年以下	4,500~9,000	3,000	6 15 22 29	11月1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