



短期市場の推移

	10月30日	10月31日	11月1日	11月2日
加重平均金利	▲0.016	▲0.020	▲0.016	▲0.011
東京レポレート(TN)	▲0.181	▲0.179	▲0.140	▲0.149
無コール残	157,667	173,513	166,662	170,205
ON	87,055	107,111	97,295	102,948
その他	70,612	66,402	69,367	67,257
有コール残	26,205	24,637	26,410	25,620

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	▲0.080	0.001	▲0.011	▲0.128
T/N	-	-	-	▲0.155
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.040	▲0.008	▲0.036	▲0.160
2W	▲0.029	0.005	▲0.024	▲0.168
3W	-	-	-	▲0.170
1M	-	-	0.001	▲0.177
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.190
6M	-	-	-	▲0.113
1Y	-	-	-	▲0.081

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7日の予定 (時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
			米 貿易収支 (9月)		

本日の市況

無担保コールON物は▲0.010%の出合から始まり、その後は主に▲0.010~▲0.008%で取引された。週末要因は剥落したものの調達意欲は衰えず、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比横ばいの▲0.011%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.020 ~ ▲0.020	▲0.001 ~ ▲0.001	▲0.010 ~ ▲0.008

翌営業日のマーケット

引き続きビッドサイドの調達意欲は強く、堅調な地合いが継続すると予想。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	11月6日		11月7日		11月8日	
券	+300		+1,000		+1,000	
財政	▲31,000		▲600		▲3,000	
過不足	▲30,700		+400		▲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				+18,600		
共通担保(全店)					▲7,100	
国債補充供給	+44,300	▲41,100	+41,100			
当座預金増減	▲27,500		+60,100		▲9,100	
当座預金残高	5,462,400		5,522,500		5,513,400	
準備預金残高	4,772,300		主な需給要因			
積み終了先	4,771,800		国債発行(物価連動10年)			
超過準備	4,771,800					
非準備先残高	690,100					
準備預金進捗率	99.9%					
平均	71.0%					
乖離率	28.9%					

11月6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
国債買入(11/7~)						
1~3年	4,250	7,961	4,253	▲0.015	▲0.014	94.7
3~5年	4,500	7,609	4,503	▲0.033	▲0.031	61.8
5~10年	6,750	8,333	6,751	▲0.054	▲0.045	60.4
10~25年	2,000	4,069	2,006	▲0.054	▲0.051	47.7
25年~	1,000	1,941	1,004	▲0.043	▲0.039	55.4
国債補充供給(11/6~11/7)						
	41,717	41,717	▲0.350	▲0.351		
	436	436	▲0.350	▲0.351		

マナリーベース [億円]
11月2日時点 6,747,000

所要	[億円]
今積期の所要準備額	4,006,500
11月7日以降の残り所要	
積数	3,200
平均	400

国債短期証券入札予定

11月9日	6ヶ月(第1193回)
11月10日	3ヶ月(第1194回)
11月16日	1年
11月17日	3ヶ月

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	11月6日	3
3年超5年以下	4,000~7,500	4,500	6 10 22 29	11月6日	3
5年超10年以下	4,500~9,000	6,750	6 15 22 29	11月6日	3
10年超25年以下	1,000~5,000	2,000	6 10 15 29	11月6日	3
25年超	500~3,500	1,000	6 15 22	11月6日	2
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