



短期市場の推移

	10月31日	11月1日	11月2日	11月6日
加重平均金利	▲0.020	▲0.016	▲0.011	▲0.011
東京レポレート(TN)	▲0.179	▲0.140	▲0.149	▲0.155
無コール残	173,513	166,662	170,205	164,508
ON	107,111	97,295	102,948	96,571
その他	66,402	69,367	67,257	67,937
有コール残	24,637	26,410	25,620	24,891

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	▲0.075	0.001	▲0.010	▲0.138
T/N	-	-	-	▲0.161
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	▲0.030	▲0.165
2W	▲0.010	0.010	0.003	▲0.168
3W	-	-	-	▲0.173
1M	-	-	-	▲0.181
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.191
6M	-	-	-	▲0.113
1Y	-	-	-	▲0.083

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8日の予定 (時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
8:50	貿易収支 (10月上中旬)			
14:00	景気動向指数速報 (9月)			
15:00	コール市場残高 (10月)			

本日の市況

無担保コールON物は▲0.007%の出合から始まり、その後は主に▲0.015~▲0.005%で取引された。引き続きビッドサイドの資金調達意欲は旺盛であり、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.001%の▲0.010%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.010 ~ ▲0.009	- ~ -	▲0.015 ~ ▲0.005

翌営業日のマーケット

引き続きビッドサイドの資金調達意欲は底堅く、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	
	11月7日	11月8日	11月8日	11月9日	11月9日	11月9日
券	+1,100	+600		+0		+0
財政	▲1,500	+900		▲1,000		▲1,000
過不足	▲400	+1,500		▲1,000		▲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		+18,600				
共通担保(全店)			▲7,100	+6,600		
社債等買入			▲200			
国債補充供給	+41,100	▲43,900	+43,900			
当座預金増減	+15,400	+45,700		▲1,000		
当座預金残高	5,477,800	5,523,500		5,522,500		
準備預金残高	4,777,600					
積み終了先	4,777,200					
超過準備	4,777,200					
非準備先残高	700,200					
準備預金進捗率	99.9%					
平均	74.2%					
乖離率	25.7%					

11月7日のオペ結果

オベ種類 オファー 応札 落札 足切 平均 按分

国庫短期証券買入(11/8~)	1,000	2,262	1,000	0.011	0.011	98.9
-----------------	-------	-------	-------	-------	-------	------

米ドル資金供給(11/9~11/16)

1	1	5.580	5.580
---	---	-------	-------

国債補充供給(11/7~11/8)

44,897	44,897	▲0.450	▲0.451
--------	--------	--------	--------

共通担保(全店)(11/8~11/22)

6,610	6,610
-------	-------

マナリーベース	所要
11月6日時点 6,719,300	今積期の所要準備額 4,009,200
	11月8日以降の残り所要
	積数 2,800
	平均 400

国庫短期証券入札予定

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

オベ種類	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