



短期市場の推移

	11月2日	11月6日	11月7日	11月8日
加重平均金利	▲0.011	▲0.011	▲0.010	▲0.010
東京レボレート(TN)	▲0.149	▲0.155	▲0.161	▲0.164
無コール残	170,205	164,508	164,400	172,523
ON	102,948	96,571	95,413	105,205
その他	67,257	67,937	68,987	67,318
有コール残	25,620	24,891	23,894	25,696

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	▲0.070	0.001	▲0.011	▲0.133
T/N	-	-	▲0.015	▲0.137
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.030	▲0.013	▲0.020	▲0.152
2W	-	-	-	▲0.159
3W	-	-	-	▲0.171
1M	-	-	0.080	▲0.178
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.192
6M	-	-	-	▲0.114
1Y	-	-	-	▲0.081

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10日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
		(米) 11月のミシガン大消費者信頼感 (速報)	

本日の市況

無担保コールON物は▲0.008%の合出から始まり、その後は主に▲0.010%~▲0.008%を中心に取引された。ビッドサイドの調達意欲は底堅く、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.001%の▲0.011%となった。

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

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ニーズは底堅く、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9日	11月10日	11月10日	11月13日	11月13日	11月13日
券	▲100	+900	+900	+1,000	+1,000	+1,000
財政	+1,000	▲14,300	▲14,300	+1,000	+1,000	+1,000
過不足	+900	▲13,400	▲13,400	+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
CP等買入	▲100	▲200	▲200			
国債補充供給	+39,100	▲37,800	+37,800			
当座預金増減	+2,100	+24,200	+24,200	+2,000	+2,000	+2,000
当座預金残高	5,485,900	5,510,100	5,510,100	5,512,100	5,512,100	5,512,100
準備預金残高	4,783,000					
積み終了先	4,782,300	国債発行(30年)	国債発行(30年)	国庫短期証券発行・償還(3M)	国庫短期証券発行・償還(3M)	国庫短期証券発行・償還(3M)
超過準備	4,782,300	国庫短期証券発行・償還(6M)	国庫短期証券発行・償還(6M)			
非準備先残高	702,900					
準備預金進捗率	99.9%					
平均	80.6%					
乖離率	19.3%					

11月9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
CP等買入(11/14~)	4,000	7,578	3,995	▲0.003	0.004	0.8
国債補充供給(11/9~11/10)	38,660	38,660	▲0.450	▲0.450		
	0	0				

マネタリーベース [億円]
11月8日時点 6,739,000

所要	[億円]
今積期の所要準備額	4,009,200
11月10日以降の残り所要	
積数	1,600
平均	300

国庫短期証券入札予定

11月10日	3ヶ月(第1194回)
11月16日	1年(第1195回)
11月17日	3ヶ月
11月24日	3ヶ月
11月14日	5年
11月21日	20年
11月28日	40年
11月30日	2年

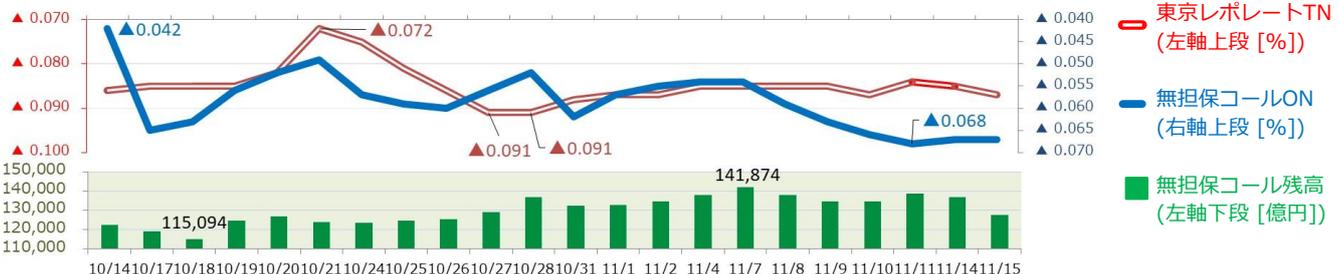
今月の国債買入オペ予定

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	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