



短期市場の推移

	11月6日	11月7日	11月8日	11月9日
加重平均金利	▲0.011	▲0.010	▲0.010	▲0.011
東京レポレート(TN)	▲0.155	▲0.161	▲0.164	▲0.137
無コール残	164,508	164,400	172,523	171,636
ON	96,571	95,413	105,205	100,458
その他	67,937	68,987	67,318	71,178
有コール残	24,891	23,894	25,696	26,187

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	▲0.070	0.001	▲0.014	▲0.137
T/N	-	-	-	▲0.125
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.040	▲0.024	▲0.029	▲0.149
2W	-	-	▲0.013	▲0.158
3W	-	-	0.005	▲0.167
1M	-	-	-	▲0.174
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.193
6M	-	-	-	▲0.117
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13日の予定 (時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
8:50	企業物価指数(10月)				

本日の市況

無担保コールON物は▲0.008%の出合から始まり、その後は主に▲0.020%~▲0.008%を中心に取引された。オファーサイドの資金放出ニーズの強まりから、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.003%の▲0.014%となった。

都銀・信託	証券	地銀
- ~ -	▲ 0.020 ~ ▲ 0.020	▲ 0.020 ~ ▲ 0.008

翌営業日のマーケット

積み期終盤のため、資金調達量を抑える動きもあり、出合水準はやや低下すると予想。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	11月10日	11月13日	11月10日	11月13日	11月14日	11月14日
券	+900	+500	+900	+500	+0	+0
財政	▲14,300	▲5,900	▲14,300	▲5,900	▲3,000	▲3,000
過不足	▲13,400	▲5,400	▲13,400	▲5,400	▲3,000	▲3,000
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				▲12,100		
CP等買入	▲200	▲100	▲200	▲100		+4,000
国債補完供給	+37,800	▲40,600	+40,600			
当座預金増減	▲16,400	+47,200	▲16,400	+47,200	+1,000	+1,000
当座預金残高	5,469,500	5,516,700	5,469,500	5,516,700	5,517,700	5,517,700
準備預金残高	4,760,400		4,760,400			
積み終了先	4,760,300		4,760,300			
超過準備	4,759,900		4,759,900			
非準備先残高	709,100		709,100			
準備預金進捗率	99.9%		99.9%			
平均	90.3%		90.3%			
乖離率	9.6%		9.6%			

11月10日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
国債買入(11/13~)						
~1年	1,500	2,663	1,503	▲0.044	▲0.011	9.1
1~3年	4,250	6,650	4,251	▲0.001	0.004	56.7
3~5年	4,500	9,725	4,504	0.016	0.018	35.4
10~25年	2,000	5,131	2,008	0.021	0.024	23.9
国債補完供給(11/10~11/13)						
	41,452	41,452	▲0.350	▲0.351		
	0	0				

マネタリーベース (億円)
 11月9日時点 6,741,200

所要 (億円)
 今積期の所要準備額 4,009,200
 11月13日以降の残り所要
 積数 100
 平均 0

国債短期証券入札予定

11月16日	1年(第1195回)
11月17日	3ヶ月(第1196回)
11月24日	3ヶ月
12月1日	3ヶ月

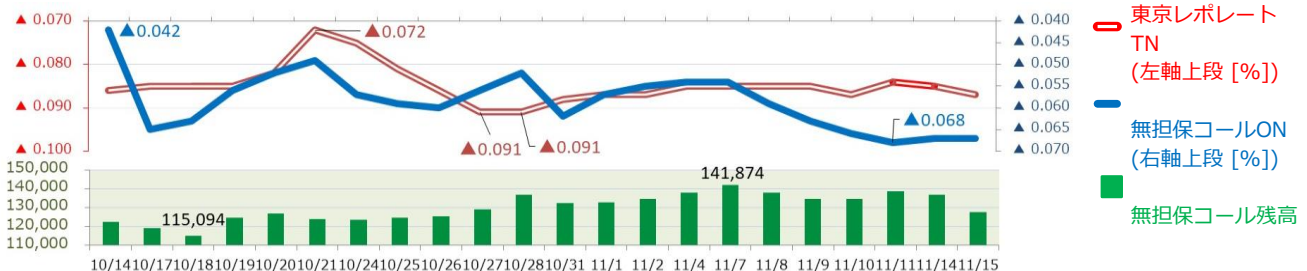
今月の国債買入オペ予定

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	11月10日	0
1年超3年以下	3,500~6,500	4,250	6 10 15 22	11月10日	2
3年超5年以下	4,000~7,500	4,500	6 10 22 29	11月10日	2
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10日	2
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