



### 短期市場の推移

	11月8日	11月9日	11月10日	11月13日
加重平均金利	▲0.010	▲0.011	▲0.014	▲0.014
東京レボレート(TN)	▲0.164	▲0.137	▲0.125	▲0.128
無コール残	172,523	171,636	185,264	159,364
ON	105,205	100,458	110,736	86,391
その他	67,318	71,178	74,528	72,973
有コール残	25,696	26,187	24,049	24,758

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	▲0.075	0.001	▲0.012	▲0.117
T/N	-	-	-	▲0.140
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	▲0.020	▲0.148
2W	▲0.040	0.005	▲0.030	▲0.157
3W	-	-	0.001	▲0.165
1M	▲0.010	▲0.009	▲0.010	▲0.177
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.194
6M	-	-	-	▲0.122
1Y	-	-	-	▲0.083

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15日の予定 (時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
8:50	7~9月の実質GDP速報	▲0.4%	22:30	(米) 10月の小売売上高	▲0.3%
	-	-		(米) 10月の生産者物価	-
	-	-		(米) 11月のNY連銀製造業指数	-

### 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▲0.008%~▲0.020%を中心に取引された。積み期終盤の調整を目的としたビッドが多く、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.002%の▲0.012%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.009 ~ ▲0.009	- ~ -	▲0.020 ~ ▲0.006

### 翌営業日のマーケット

オファー・ビッドの動向に大きな変化はなく、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14日	11月15日	11月15日	11月16日	11月16日	11月16日
券		+400	+300	▲1,000		
財政		+3,000	▲33,900	+6,000		
過不足		+3,400	▲33,600	+5,000		
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	+4,000	▲300			
国債補充供給	+42,100	▲36,100	+36,100			
当座預金増減		+13,300	+2,200	+5,000		
当座預金残高		5,487,900	5,490,100	5,495,100		
準備預金残高		4,790,500				
積み終了先		4,790,500	国債発行(5年・個人向け)			
超過準備		4,790,400				
非準備先残高		697,400				
準備預金進捗率		100.0%				
平均乖離率		96.8%				
		3.2%				

### 11月14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
米ドル資金供給(11/16~11/24)						
	1	1	5,580	5,580		
国債補充供給(11/14~11/15)						
	36,840	36,840	▲0.350	▲0.351		
	112	112	▲0.350	▲0.350		

マナタリーベース [億円]  
 11月13日時点 6,728,500

所要	[億円]
今積期の所要準備額	4,009,200
11月15日以降の残り所要積数	0
平均	0

### 国庫短期証券入札予定

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
11月21日	20年
11月28日	40年
11月30日	2年
12月5日	10年

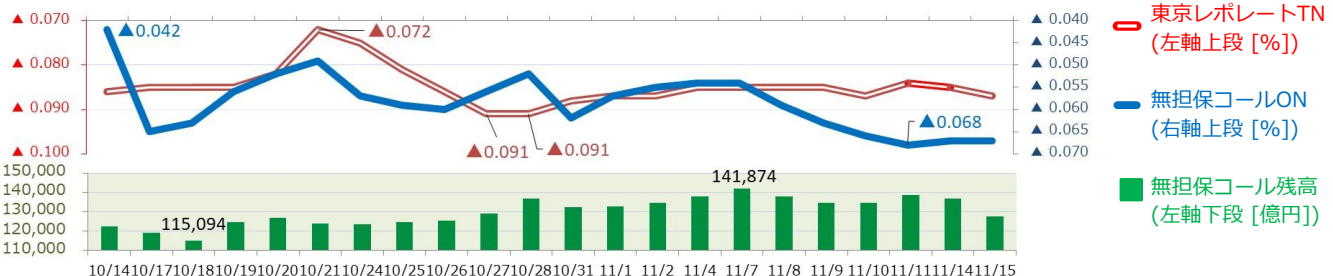
### 今月の国債買入オペ予定

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	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