



短期市場の推移

	11月9日	11月10日	11月13日	11月14日
加重平均金利	▲0.011	▲0.014	▲0.014	▲0.012
東京レボレート(TN)	▲0.137	▲0.125	▲0.128	▲0.140
無コール残	171,636	185,264	159,364	167,414
ON	100,458	110,736	86,391	93,731
その他	71,178	74,528	72,973	73,683
有コール残	26,187	24,049	24,758	25,986

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	▲0.070	0.001	▲0.011	▲0.104
T/N	-	-	-	▲0.154
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.029	0.000	▲0.015	▲0.165
2W	▲0.035	▲0.013	▲0.027	▲0.175
3W	-	-	-	▲0.176
1M	-	-	▲0.010	▲0.185
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.195
6M	-	-	-	▲0.120
1Y	-	-	-	▲0.082

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16日の予定 (時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
8:50	10月貿易収支			
	-			
	-			

本日の市況

無担保コールON物は▲0.01%の出合から始まり、その後は主に▲0.008%~▲0.013%を中心に取引された。積み最終日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+0.001%の▲0.011%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.009 ~ ▲0.010	- ~ -	▲0.013 ~ ▲0.006

翌営業日のマーケット

新積み期初日のため、ビッドサイドの様子見姿勢もあり、本日対比低下を予想する。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	11月15日	11月16日	11月16日	11月17日	11月17日	11月18日
券	+300	▲700		+0		
財政	▲33,000	▲9,700		▲3,000		
過不足	▲32,700	▲10,400		▲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		+100	▲100	+12,700		
共通担保(全店)						
CP等買入	▲300					
国債補充供給	+36,100	▲38,000	+38,000			
当座預金増減	▲34,800	+40,200		▲3,000		
当座預金残高	5,453,100	5,493,300		5,490,300		
準備預金残高	4,762,900					
積み終了先	4,762,900					
超過準備	4,762,900					
非準備預金先高	690,200					
準備預金進捗率	100.0%					
平均	100.0%					
乖離率	0.0%					

11月15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(11/16~)						
1~3年	3,750	5,966	3,752	▲0.046	▲0.035	26.5
5~10年	5,750	11,478	5,753	▲0.080	▲0.078	56.8
10~25年	2,000	4,484	2,006	▲0.085	▲0.084	79.2
25年~	1,000	2,491	1,006	▲0.085	▲0.081	41.8
国債補充供給(11/15~11/16)						
	38,847	38,847	▲0.350	▲0.350		
	0	0				
共通担保(全店)(11/15~11/16)						
	1,000	52	52			

マナリーベース (億円)
11月14日時点 6,741,400

所要	(億円)
来積期の所要準備額	3,891,200
11月16日以降の残り所要	
積数	3,891,200
平均	129,700

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

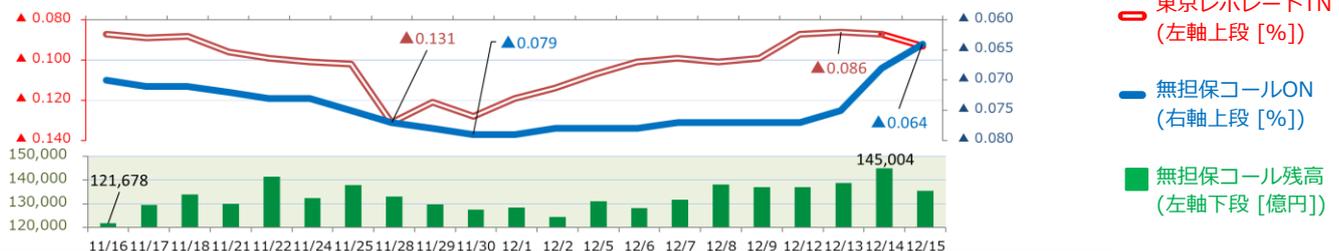
今月の国債買入オペ予定

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	3,750	6 10 15 22	11月15日	1
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	5,750	6 15 22 29	11月15日	2
10年超25年以下	1,000~5,000	2,000	6 10 15 29	11月15日	1
25年超	500~3,500	1,000	6 15 22	11月15日	1
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11月積み期 [11月16日~12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