



短期市場の推移

	10月27日	10月28日	10月29日	11月1日
加重平均金利	▲0.027	▲0.027	▲0.027	▲0.029
東京レボレート(TN)	▲0.096	▲0.111	▲0.096	▲0.096
無コール残	169,503	171,341	166,287	162,181
ON	88,033	88,521	86,197	82,441
その他	81,470	82,820	80,090	79,740
有コール残	17,006	17,083	16,782	17,363

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	0.020	▲0.031	▲0.093
T/N	-	-	▲0.045	▲0.095
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.008	0.000	▲0.007	▲0.096
2W	▲0.025	▲0.001	▲0.014	▲0.098
3W	-	-	-	▲0.100
1M	-	-	▲0.010	▲0.104
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.113
6M	-	-	-	▲0.120
1Y	-	-	-	▲0.131

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4日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	3:00 (米)11月連邦公開市場委員会(FOMC)政策金利	0.25%
-	-	21:30 (英)9月貿易収支	-736億米ドル
-	-	21:00 (英)11月英中銀(BOE)政策金利	0.1%

経済指標及び予想値は株式会社フィスコ提供

本日の市況

本日の無担保コールON物は▲0.050%の出合から始まり、その後は主に▲0.050%~▲0.015%の水準で出合が見られた。地銀業態の一部で調達ニーズの弱まりも見られ、同加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.002%の▲0.031%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.062 ~ ▲0.062	▲0.050 ~ ▲0.050	▲0.055 ~ ▲0.010

翌営業日のマーケット

大きな地合の変化はなく、出合水準は本日対比横ばいから若干の低下を予想。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	11月2日	11月4日	11月4日	11月5日	11月5日	11月5日
券	▲300	▲400	▲400	+800	+800	+800
財政	▲42,600	+6,300	+6,300	+1,000	+1,000	+1,000
過不足	▲42,900	+5,900	+5,900	+1,800	+1,800	+1,800
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				+10,700		
国債補完供給	+200	▲200	+200			
当座預金増減	▲42,900	+17,800	+17,800	+1,800	+1,800	+1,800
当座預金残高	5,350,400	5,368,200	5,368,200	5,370,000	5,370,000	5,370,000
準備預金残高	4,710,900					
積み終了先	4,710,800					
超過準備	4,710,800					
非準備先残高	639,500					
準備預金進捗率	99.9%					
平均	61.3%					
乖離率	38.6%					

11月2日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
国庫短期証券買入(11/4~)	1,000	7,413	1,001	0.006	0.006	97.9
国債買入(11/4~)						
1~3年	4,500	9,294	4,507	0.002	0.002	82.3
3~5年	4,500	9,222	4,506	0.001	0.002	18.3
10~25年	1,500	3,693	1,513	0.005	0.007	8.5
米ドル資金供給(11/4~11/12)						
0	0	0.330	0.330			
国債補完供給(11/2~11/4)						
176	176	▲0.350	▲0.350			
0	0					

マネタリーベース (億円)
 11月1日時点 6,617,500

所要	(億円)
今積期の所要準備額	3,735,100
11月4日以降の残り所要	
積数	100
平均	0

国庫短期証券入札予定

11月5日	3ヶ月(第1035回)
11月9日	6ヶ月(第1036回)
11月12日	3ヶ月
11月18日	1年
国債入札予定	
11月4日	物価連動
11月9日	30年
11月16日	5年
11月18日	20年

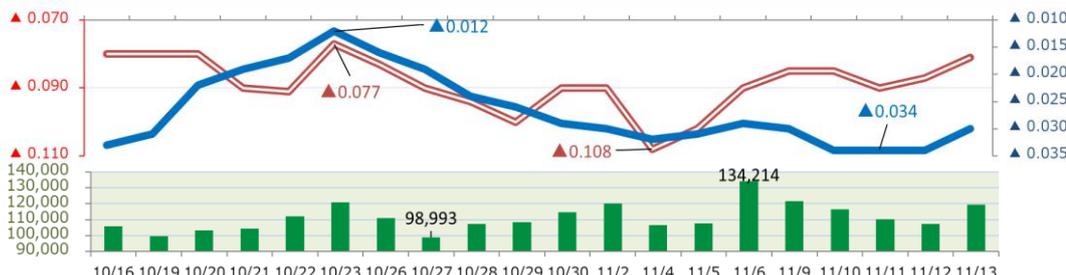
今月の国債買入オペ予定

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8日	1
1年超3年以下	4500	4,500	2 10 17 24	11月2日	3
3年超5年以下	4500	4,500	2 10 24 29	11月2日	3
5年超10年以下	4250	4,250	10 17 24 29	10月26日	4
10年超25年以下	1500	1,500	2	11月2日	0
25年超	500	500	17	10月20日	1
物価連動債	600	600	月1回	10月26日	1
変動利付債<四半期>	300	300	四半期に1回	10月13日	-

1年前の市場推移

○2020年10月積み期 [10月16日~11月13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。



東京レボレートTN (左軸上段 [%])

無担保コールON (右軸上段 [%])

無担保コール残高 (左軸下段 [億円])

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