



短期市場の推移

	10月28日	10月29日	11月1日	11月2日
加重平均金利	▲0.027	▲0.027	▲0.029	▲0.031
東京レボレート(TN)	▲0.111	▲0.096	▲0.096	▲0.095
無コール残	171,341	166,287	162,181	156,612
ON	88,521	86,197	82,441	79,229
その他	82,820	80,090	79,740	77,383
有コール残	17,083	16,782	17,363	18,166

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	▲0.033	▲0.092
T/N	▲0.048	▲0.020	▲0.035	▲0.095
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.008	▲0.001	▲0.003	▲0.096
2W	-	-	▲0.008	▲0.098
3W	-	-	-	▲0.100
1M	▲0.005	0.000	▲0.002	▲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5日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	(米)10月非農業部門雇用者数	40.0万人
-	-	(米)10月失業率	4.7%
-	-	(米)10月平均時給[前年比]	4.9%

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▲0.020%の合出から始まり、その後は主に▲0.060%~▲0.020%の水準で合出が見られた。一部調達サイドで調達量を抑制する先もあり、同加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.002%の▲0.033%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.060 ~ ▲0.060	▲0.055 ~ ▲0.055	▲0.055 ~ ▲0.015

翌営業日のマーケット

3日積みとなる明日も調達サイドの動向に大きな変化はなく、出合水準は本日対比横ばいを予想。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想
	11月4日	11月5日	11月5日	11月8日	11月8日
券	▲300	+600	+600	+2,000	+2,000
財政	+10,000	+5,900	+5,900	▲2,000	▲2,000
過不足	+9,700	+6,500	+6,500	+0	+0
金融調節	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド
国庫短期証券買入		+1,000			
国債買入		+10,700			
CP等買入			▲300		
国債補完供給	+200	▲500	+500		
当座預金増減	+21,100	+6,700	+6,700	+0	+0
当座預金残高	5,371,500	5,378,200	5,378,200	5,378,200	5,378,200
準備預金残高	4,741,000				
積み終了先	4,741,000				
超過準備	4,741,000				
非準備預金残高	630,500				
準備預金進捗率	99.9%				
平均	64.5%				
乖離率	35.4%				

11月4日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
国債補完供給(11/4~11/5)	439	439	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マネタリーベース (億円)
 11月2日時点 6,574,900

所要	(億円)
今積期の所要準備額	3,735,100
11月5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
11月9日	30年
11月16日	5年
11月18日	20年
11月25日	40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 17	11月2日	0
25年超	500	500		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。



東京レポレート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