



短期市場の推移

	10月29日	11月1日	11月2日	11月4日
加重平均金利	▲0.027	▲0.029	▲0.031	▲0.033
東京レポレート(TN)	▲0.096	▲0.096	▲0.095	▲0.095
無コール残	166,287	162,181	156,612	152,264
ON	86,197	82,441	79,229	75,641
その他	80,090	79,740	77,383	76,623
有コール残	16,782	17,363	18,166	18,430

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	▲0.080	0.001	▲0.036	▲0.094
T/N	-	-	-	▲0.095
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.005	0.000	▲0.004	▲0.095
2W	-	-	-	▲0.099
3W	-	-	-	▲0.101
1M	▲0.022	▲0.003	▲0.013	▲0.103
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.113
6M	-	-	-	▲0.120
1Y	-	-	-	▲0.131

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8日の予定 (時刻は日本時間)

時刻	日本	予想	海外	予想
	8:50	日銀金融政策決定会合における 主な意見 (10月27・28日)		-
	-		-	
	-		-	

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▲0.025%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。地銀業態を中心に調達を抑制する動きが見られ、同加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.003%の▲0.036%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

地銀業態を中心に調達を控える先も散見されるため、出合いの水準は本日対比で低下を予想。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	11月5日	11月8日	11月8日	11月9日	11月9日	11月9日
券	+600	+900	+900	+0	+0	+0
財政	+3,900	+2,900	+2,900	+2,000	+2,000	+2,000
過不足	+4,500	+3,800	+3,800	+2,000	+2,000	+2,000
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	▲300	▲100	▲100			
国債補充供給	+500	+800	+800			
当座預金増減	+3,900	+4,500	+4,500	+2,000	+2,000	+2,000
当座預金残高	5,375,400	5,379,900	5,379,900	5,381,900	5,381,900	5,381,900
準備預金残高	4,736,200	4,736,200	4,736,200	4,736,200	4,736,200	4,736,200
積み終了先	4,736,200	4,736,200	4,736,200	4,736,200	4,736,200	4,736,200
超過準備	4,736,200	4,736,200	4,736,200	4,736,200	4,736,200	4,736,200
非準備先残高	639,200	639,200	639,200	639,200	639,200	639,200
準備預金進捗率	99.9%	99.9%	99.9%	99.9%	99.9%	99.9%
平均	74.2%	74.2%	74.2%	74.2%	74.2%	74.2%
乖離率	25.7%	25.7%	25.7%	25.7%	25.7%	25.7%

11月5日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
社債等買入(11/10~)	1,250	2,190	1,251	▲0.055	▲0.043	75.4
国債補充供給(11/5~11/8)	775	775	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マネタリーベース (億円)
11月4日時点 6,596,300

所要	(億円)
今積期の所要準備額	3,741,700
11月8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

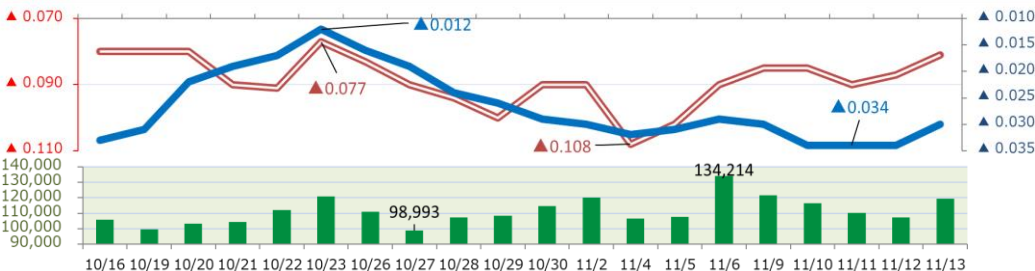
今月の国債買入オペ予定

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