



短期市場の推移

	11月1日	11月2日	11月4日	11月5日
加重平均金利	▲0.029	▲0.031	▲0.033	▲0.036
東京レポレート(TN)	▲0.096	▲0.095	▲0.095	▲0.095
無コール残	162,181	156,612	152,264	156,672
ON	82,441	79,229	75,641	73,449
その他	79,740	77,383	76,623	83,223
有コール残	17,363	18,166	18,430	17,846

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	▲0.087	0.001	▲0.045	▲0.091	
T/N	-	-	▲0.060	▲0.093	
S/N	-	-	-	-	
1W	▲0.040	▲0.001	▲0.023	▲0.095	
2W	▲0.030	▲0.015	▲0.017	▲0.098	
3W	-	-	▲0.001	▲0.099	
1M	▲0.020	▲0.005	▲0.016	▲0.103	
2M	-	-	-	-	
3M	-	-	-	▲0.114	
6M	-	-	-	▲0.120	
1Y	-	-	-	▲0.130	

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9日の予定 (時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
8:50	9月国際収支(経常収支)	11,059億円	22:30	(米)10月生産者物価コア指数 [前年比]	6.8%
	-			-	
	-			-	

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▲0.070%~▲0.020%の水準で出合が見られた。ビットサイドでニーズの減少から調達を抑制する先が目立ち、同加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.009%の▲0.045%となった。また、日本銀行より10月のコール市場残高が発表され、平残は15兆4,232億円と2008年6月以来13年ぶりに15兆円台を記録した。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.080 ~ ▲0.080	▲0.055 ~ ▲0.055	▲0.070 ~ ▲0.020

翌営業日のマーケット

引き続き地銀業態を中心に調達ニーズの減少が見込まれ、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8日	11月9日	11月9日	11月10日	11月10日	11月10日
券		+900		+800		▲1,000
財政		+600		▲500		▲14,000
過不足		+1,500		+300		▲15,000
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
共通担保(全店)						▲2,400
CP等買入	▲100		▲100			
社債等買入						+1,300
国債補充供給	+800	▲300	+300			
当座預金増減		+1,900		+500		▲16,100
当座預金残高		5,377,300		5,377,800		5,361,700
準備預金残高		4,751,900	主な需給要因			
積み終了先		4,751,900				国債発行(30年)
超過準備		4,751,900				国庫短期証券発行・償還(6M)
非準備先残高		625,400				
準備預金進捗率		99.9%				
平均		77.4%				
乖離率		22.5%				

11月8日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
国債補充供給(11/8~11/9)	264	264	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マネタリーベース (億円)
 11月5日時点 6,599,600

所要	(億円)
今積期の所要準備額	3,741,700
11月9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9日	6ヶ月(第1036回)
11月12日	3ヶ月(第1037回)
11月18日	1年
11月19日	3ヶ月
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