



短期市場の推移

[億円] [%]

	11月2日	11月4日	11月5日	11月8日
加重平均金利	▲0.031	▲0.033	▲0.036	▲0.045
東京レボレート(TN)	▲0.095	▲0.095	▲0.095	▲0.093
無コール残	156,612	152,264	156,672	151,532
ON	79,229	75,641	73,449	69,774
その他	77,383	76,623	83,223	81,758
有コール残	18,166	18,430	17,846	17,816

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	▲0.087	0.001	▲0.051	▲0.085
T/N	-	-	▲0.060	▲0.086
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	▲0.025	▲0.090
2W	-	-	-	▲0.095
3W	-	-	-	▲0.098
1M	-	-	0.150	▲0.102
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.113
6M	-	-	-	▲0.120
1Y	-	-	-	▲0.130

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10日の予定 (時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
	-		22:30	(米)10月消費者物価コア指数[前年比]	4.3%
	-			-	
	-			-	

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▲0.075%～▲0.020%の水準で出合が見られた。昨日と同様にビッドサイドの調達ニーズは弱く、軟調な地合となったため、同加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.006%の▲0.051%となった。また、日本銀行は11月積み期におけるマクロ加算残高の算出に用いる基準比率を9.0%に定めることとした。

[%]		
都銀・信託	証券	地銀
▲ 0.086 ～ ▲ 0.085	▲ 0.060 ～ ▲ 0.060	▲ 0.070 ～ ▲ 0.020

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

[億円]

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想
	11月9日		11月10日		11月11日
券	+900		+700		▲1,000
財政	▲900		▲13,700		+2,000
過不足	+0		▲13,000		+1,000
金融調節	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド
共通担保(全店)	▲100		▲2,400		+2,500
CP等買入	▲100		▲600		
社債等買入			+1,300		
国債補充供給	+300	▲200	+200		
当座預金増減	+0		▲12,000		+1,000
当座預金残高	5,377,300		5,365,300		5,366,300
準備預金残高	4,764,500		4,764,500		主な需給要因
積み終了先	4,764,500		国債発行(30年)		
超過準備	4,764,500		国庫短期証券発行・償還(6M)		
非準備先残高	612,800				
準備預金進捗率	100.0%				
平均	80.6%				
乖離率	19.4%				

11月9日のオペ結果

[%][億円]※米ドル資金供給は百万\$

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
------	------	----	----	----	----	----

米ドル資金供給(11/12～11/18)

0 0 0.330 0.330

国債補充供給(11/9～11/10)

144 144 ▲0.350 ▲0.350

共通担保(全店)(11/10～11/24)

20,000 2,451 2,451

マネタリーベース [億円]

11月8日時点 6,600,500

所要

今積期の所要準備額 3,741,700

11月10日以降の残り所要

積数 0

平均 0

国庫短期証券入札予定

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24日	6ヶ月
国債入札予定	
11月16日	5年
11月18日	20年
11月25日	40年
11月30日	2年

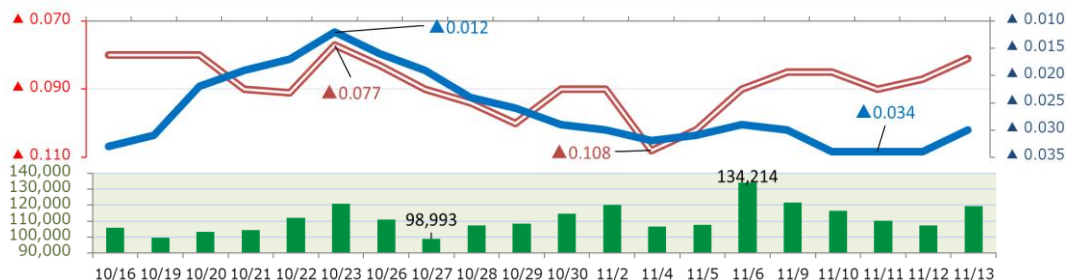
今月の国債買入オペ予定

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