



短期市場の推移

[億円] [%]

	11月4日	11月5日	11月8日	11月9日
加重平均金利	▲0.033	▲0.036	▲0.045	▲0.051
東京レボレート(TN)	▲0.095	▲0.095	▲0.093	▲0.086
無コール残	152,264	156,672	151,532	142,751
ON	75,641	73,449	69,774	61,093
その他	76,623	83,223	81,758	81,658
有コール残	18,430	17,846	17,816	17,899

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	▲0.086	0.001	▲0.049	▲0.083
T/N	-	-	▲0.060	▲0.086
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	0.050	▲0.090
2W	▲0.049	▲0.009	▲0.038	▲0.094
3W	▲0.003	▲0.001	▲0.002	▲0.098
1M	▲0.028	▲0.005	▲0.015	▲0.101
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.114
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

資金需給

[億円]

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	11月10日	11月11日	11月11日	11月12日	11月12日	11月12日
券		+700		▲200		▲1,000
財政		▲14,400		+400		+3,000
過不足		▲13,700		+200		+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
国債買入				+13,400		
共通担保(全店)	▲2,400	+2,500				
CP等買入	▲600		▲100			
社債等買入		+1,300				
国債補充供給	+200	▲100	+100			
当座預金増減		▲12,800		+13,600		+2,000
当座預金残高		5,364,500		5,378,100		5,380,100
準備預金残高		4,755,000				
積み終了先		4,755,000				
超過準備		4,755,000				
非準備先残高		609,500				
準備預金進捗率		100.0%				
平均		83.9%				
乖離率		16.1%				

11月10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
国債買入(11/11~)						
1~3年	4,500	12,749	4,511	0.000	0.001	82.8
3~5年	4,500	12,610	4,505	▲0.004	▲0.003	14.0
5~10年	4,250	10,016	4,260	▲0.006	▲0.005	54.8
国債補充供給(11/10~11/11)						
	93	93	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マネタリーベース [億円]

11月9日時点 6,599,600

所要

今積期の所要準備額 3,741,700

11月11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

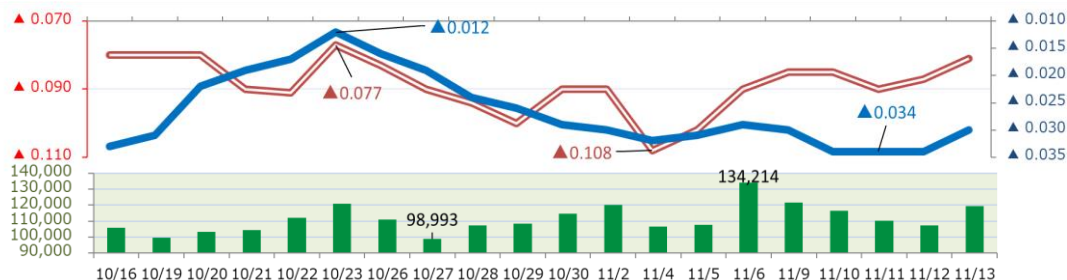
今月の国債買入オペ予定

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10日	2
3年超5年以下	4500	4,500	2 10 24 29	11月10日	2
5年超10年以下	4250	4,250	10 17 24 29	11月10日	3
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<4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