



短期市場の推移

[億円] [%]

	10月26日	10月27日	10月28日	10月31日
加重平均金利	▲0.060	▲0.056	▲0.052	▲0.062
東京レボレート(TN)	▲0.086	▲0.091	▲0.091	▲0.088
無コール残	125,367	129,209	136,688	132,452
ON	59,951	63,373	71,702	72,655
その他	65,416	65,836	64,986	59,797
有コール残	32,465	31,851	33,203	29,360

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	▲0.085	0.001	▲0.057	▲0.085
T/N	-	-	-	▲0.087
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.060	▲0.055	▲0.058	▲0.090
2W	▲0.019	▲0.003	▲0.014	▲0.099
3W	-	-	-	▲0.104
1M	▲0.055	0.150	▲0.024	▲0.109
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.134
6M	-	-	-	▲0.140
1Y	-	-	-	▲0.134

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2日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	(米)FOMC (2日まで) パウエルFRB議長記者会見	-
-	-	21:15 (米)10月ADP全米雇用報告	20.0万人
-	-	-	-

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▲0.055%の割合から始まり、その後は主に▲0.065%～▲0.055%の水準で取引された。前営業日に月末要因で調達を控えていた先が取引を再開したため、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.005%の▲0.057%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.065 ~ ▲0.060	▲0.058 ~ ▲0.058	▲0.060 ~ ▲0.055

翌営業日のマーケット

ビットサイドの調達意欲は引き続き強く、出合水準は本日対比で上昇すると予想。

資金需給

[億円]

	日銀速報	日銀予想	当社需給予想
	11月1日	11月2日	11月4日
券	▲300	▲600	+0
財政	▲38,500	▲22,900	+0
過不足	▲38,800	▲23,500	+0
金融調節	エンド	スタート	エンド
国庫短期証券買入	+1,000		
国債補完供給	+23,700	▲23,200	+23,200
当座預金増減	▲37,300	▲300	+0
当座預金残高	4,915,800	4,915,500	4,915,500
準備預金残高	4,270,200		主な需給要因
積み終了先	4,270,000	税保険揚げ	
超過準備	4,269,900	普通交付税交付金	
非準備先残高	645,600	国債発行(10年)	
準備預金進捗率	99.9%		
平均	54.8%		
乖離率	45.1%		

11月1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(固定利回り方式)(11/2~)

5~10年 0 0

5~10年 0 0

米ドル資金供給(11/4~11/10)

0 0 3.980 3.980

国債補完供給(11/1~11/2)

23,180 23,180 ▲0.350 ▲0.350

0 0

マネタリーベース [億円]

10月31日時点 6,208,700

所要

[億円]

今積期の所要準備額 3,874,800

11月2日以降の残り所要

積数 1,200

平均 100

国庫短期証券入札予定

11月4日	3ヶ月(第1118回)
11月9日	6ヶ月
11月11日	3ヶ月
11月17日	1年

国債入札予定

11月7日	物価連動
11月9日	30年
11月15日	5年
11月17日	20年

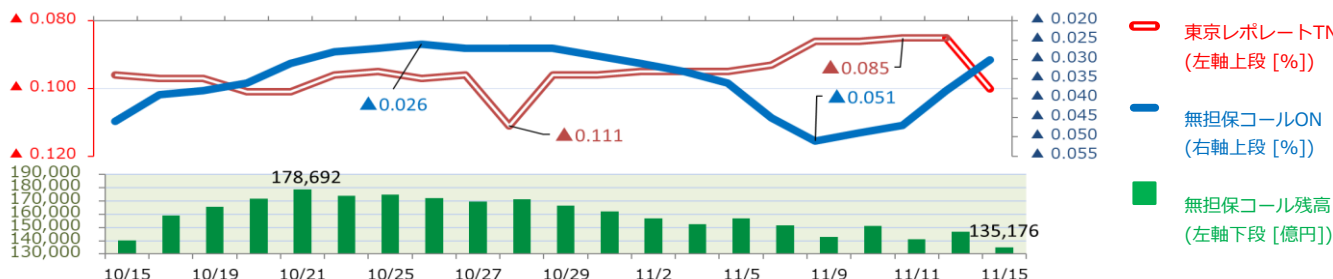
今月の国債買入オペ予定

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5日	1
1年超3年以下	4750	5,000	2 8 14 21	10月21日	4
3年超5年以下	4750	5,750	2 8 21 28	10月26日	4
5年超10年以下	5500	6,500	8 14 21 28	10月26日	4
10年超25年以下	2500	3,500	8 21 28	10月26日	3
25年超	1000	1,500	2 14 28	10月26日	3
物価連動債	600	600	月1回	10月21日	1
変動利付債<四半期>	300	300	四半期に1回	10月17日	-

1年前の市場推移

○2021年10月積み期 [10月15日~11月15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。



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