



短期市場の推移

	10月27日	10月28日	10月31日	11月1日
加重平均金利	▲0.056	▲0.052	▲0.062	▲0.057
東京レボレート(TN)	▲0.091	▲0.091	▲0.088	▲0.087
無コール残	129,209	136,688	132,452	132,572
ON	63,373	71,702	72,655	71,485
その他	65,836	64,986	59,797	61,087
有コール残	31,851	33,203	29,360	30,899

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	▲0.085	0.001	▲0.055	▲0.084
T/N	-	-	-	▲0.087
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	-	▲0.091
2W	▲0.058	0.180	▲0.040	▲0.097
3W	-	-	-	▲0.102
1M	▲0.070	0.200	0.003	▲0.108
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.135
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4日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	(米)10月非農業部門雇用者数	20.0万人
-	-	(米)10月失業率	3.6%
-	-	-	-

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▲0.060%の合出から始まり、その後は主に▲0.065%~▲0.055%の水準で取引された。2日積みであったがレートの上昇は限定的であり、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.002%の▲0.055%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.060 ~ ▲0.060	▲0.060 ~ ▲0.060	▲0.060 ~ ▲0.053

翌営業日のマーケット

週末3日積みのため調達ニーズが強まるが見込まれ、出合水準は本日対比で上昇すると予想。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想
	11月2日	11月4日	11月4日	11月7日	11月7日
券	▲500	▲400	▲400	+1,000	+1,000
財政	▲24,900	+600	+600	▲4,000	▲4,000
過不足	▲25,400	+200	+200	▲3,000	▲3,000
金融調節	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド
国債買入				+12,100	
CP等買入			▲300		
国債補完供給	+23,200	▲12,500	+12,500		
当座預金増減	▲14,700	+24,500	+24,500	▲3,000	▲3,000
当座預金残高	4,901,100	4,925,600	4,925,600	4,922,600	4,922,600
準備預金残高	4,266,700				
積み終了先	4,266,600				
超過準備	4,266,500				
非準備先残高	634,400				
準備預金進捗率	99.9%				
平均	61.3%				
乖離率	38.6%				

11月2日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
国債買入(固定利回り方式)(11/4~)						
5~10年	30	30				
5~10年	0	0				
国債買入(11/4~)						
~1年	1,500	2,238	1,503	▲0.010	0.002	9.5
1~3年	4,750	14,624	4,754	▲0.003	▲0.001	21.3
3~5年	4,750	8,327	4,752	▲0.002	0.001	3.3
25年~	1,000	2,559	1,003	0.019	0.021	38.8
国債補完供給(11/2~11/4)						
12,513	12,513	▲0.350	▲0.350			
0	0					

マナタリーベース 【億円】
 11月1日時点 6,171,600

所要	【億円】
今積期の所要準備額	3,874,800
11月4日以降の残り所要	
積数	900
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(第1119回)
11月11日	3ヶ月
11月17日	1年
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

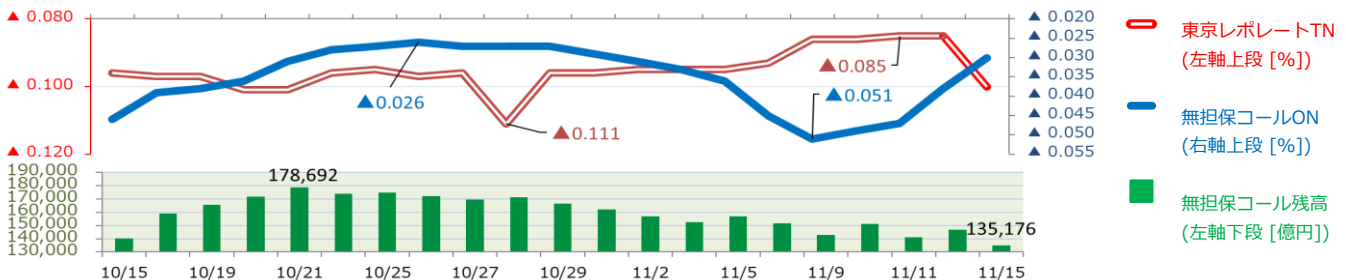
今月の国債買入オペ予定

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	11月2日	0
1年超3年以下	4750	4,750	2 8 14 21	11月2日	3
3年超5年以下	4750	4,750	2 8 21 28	11月2日	3
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	1,000	2 14 28	11月2日	2
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	0

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