



短期市場の推移

[億円] [%]

	10月31日	11月1日	11月2日	11月4日
加重平均金利	▲0.062	▲0.057	▲0.055	▲0.054
東京レボレート(TN)	▲0.088	▲0.087	▲0.087	▲0.085
無コール残	132,452	132,572	134,727	138,052
ON	72,655	71,485	72,790	74,865
その他	59,797	61,087	61,937	63,187
有コール残	29,360	30,899	30,844	31,195

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	▲0.080	0.030	▲0.054	▲0.084
T/N	-	-	-	▲0.085
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	▲0.060	▲0.089
2W	▲0.060	▲0.023	▲0.042	▲0.094
3W	-	-	-	▲0.101
1M	-	-	▲0.055	▲0.109
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.131
6M	-	-	-	▲0.139
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8日の予定 (時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
金融政策決定会合 における主な意見 (10/27・28開催分)			(米)中間選挙		
-			-		
-			-		

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%の出来から始まり、その後は主に▲0.060%~▲0.055%の水準で取引された。3日積み要因の剥落により、ビッドサイドの調達意欲の減退も見られたが、一部金融機関による試し取りも行われたため、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比横ばいの▲0.054%となった。

都銀・信託		証券	地銀
▲0.065 ~ ▲0.065		- ~ -	▲0.060 ~ ▲0.050

翌営業日のマーケット

一部の先で調達ニーズの減退も想定され、出合いの水準は本日対比低下を予想。

資金需給

[億円]

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想
	11月7日		11月8日		11月9日
券	+700		+300		+0
財政	▲6,500		▲900		+1,000
過不足	▲5,800		▲600		+1,000
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	+700		+100		スタート
共通担保(全店)	▲200		▲10,300		
CP等買入	+12,700		+11,500		
国債補完供給	▲11,500		+11,500		
当座預金増減	▲4,100		+11,000		▲9,300
当座預金残高	4,909,300		4,920,300		4,911,000
準備預金残高	4,303,700		4,303,500		主な需給要因
積み終了先	4,303,500		4,303,500		物価連動国債発行
超過準備	4,303,500		4,303,500		(10年)
非準備先残高	605,600		605,600		
準備預金進捗率	99.9%		99.9%		
平均	74.2%		74.2%		
乖離率	25.7%		25.7%		

11月7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)(11/8~)						
5~10年	61	61				
5~10年	0	0				
国債補完供給(11/7~11/8)						
	11,517	11,517	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マネタリーベース [億円]

11月4日時点 6,170,100

所要

[億円]

今積期の所要準備額	3,871,400
11月8日以降の残り所要	
積数	500
平均	100

国庫短期証券入札予定

11月9日	6ヶ月(第1119回)
11月11日	3ヶ月(第1120回)
11月17日	1年
11月18日	3ヶ月

国債入札予定

11月9日	30年
11月15日	5年
11月17日	20年
11月25日	40年

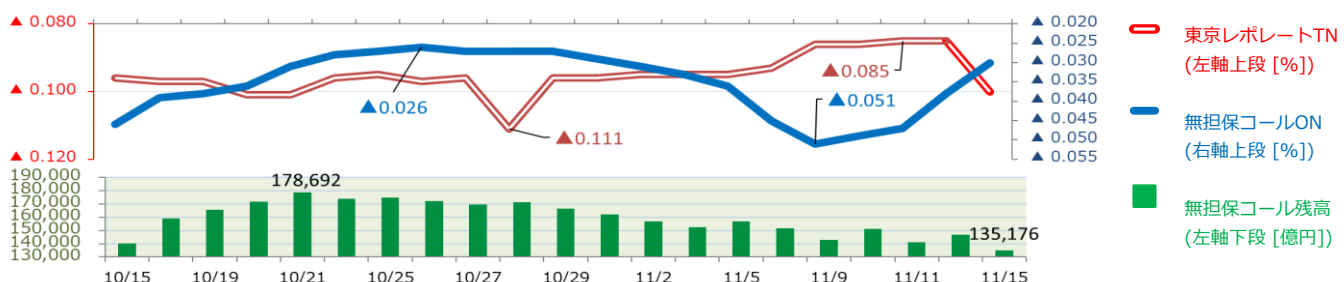
今月の国債買入オペ予定

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	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