



短期市場の推移

	11月1日	11月2日	11月4日	11月7日
加重平均金利	▲0.057	▲0.055	▲0.054	▲0.054
東京レポレート(TN)	▲0.087	▲0.087	▲0.085	▲0.085
無コール残	132,572	134,727	138,052	141,874
ON	71,485	72,790	74,865	79,667
その他	61,087	61,937	63,187	62,207
有コール残	30,899	30,844	31,195	31,372

加重平均金利・コール残高は日銀、東京レポ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)			レポ市場
	最低	最高	平均	東京レポレート
O/N	▲0.080	0.001	▲0.059	▲0.086
T/N	-	-	-	▲0.085
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.063	▲0.015	▲0.039	▲0.089
2W	-	-	-	▲0.095
3W	-	-	-	▲0.101
1M	-	-	▲0.057	▲0.109
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.130
6M	-	-	-	▲0.139
1Y	-	-	-	▲0.134

無担保コール(速報)は日銀、東京レポレートは日本証券業協会公表

11月9日の予定 (時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
8:50	9月国際収支 (経常収支)	2821億円	-	-
	-	-	-	-
	-	-	-	-

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▲0.065%の出合から始まり、その後は主に▲0.070%~▲0.060%の水準で取引された。ビッドサイドの調達意欲が限定的となり、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.005%の▲0.059%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.065 ~ ▲0.065	- ~ -	▲0.070 ~ ▲0.060

翌営業日のマーケット

引き続きビッドサイドの調達意欲は限定的で、出合いの水準は本日と横ばい圏を予想。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	11月8日		11月9日		11月10日	
券	+300		+700		▲1,000	
財政	▲2,400		▲1,400		▲18,000	
過不足	▲2,100		▲700		▲19,000	
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
国庫短期証券買入				+1,000		
国債買入		+100		+18,000		
共通担保(全店)			▲10,300	+5,800		
CP等買入			▲100			
国債補充供給	+11,500	▲12,500	+12,500			
当座預金増減	▲3,000		+26,200		▲19,000	
当座預金残高	4,906,300		4,932,500		4,913,500	
準備預金残高	4,304,300		主な需給要因			
積み終了先	4,304,200		国債発行		(30年)	
超過準備	4,304,200		国庫短期証券		発行・償還 (6M)	
非準備預金残高	602,000					
準備預金進捗率	99.9%					
平均	77.4%					
乖離率	22.5%					

11月8日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
国庫短期証券買入(11/9~)	1,000	5,906	1,001	0.012	0.015	54.1
国債買入(固定利回り方式)(11/9~)						
5~10年	0	0				
5~10年	0	0				
国債買入(11/9~)						
1~3年	4,750	13,130	4,754	▲0.004	▲0.003	42.9
3~5年	4,750	7,686	4,755	▲0.006	▲0.004	75.6
5~10年	5,500	16,683	5,513	▲0.002	▲0.001	82.5
10~25年	2,500	7,635	2,510	0.018	0.020	8.4
米ドル資金供給(11/10~11/17)	0	0	4,090	4,090		
国債補充供給(11/8~11/9)	12,453	12,453	▲0.350	▲0.350		
	0	0				
共通担保(全店)(11/9~11/24)	5,801	5,801				

マナターベース	所要
11月7日時点	6,165,300
今積期の所要準備額	3,871,400
11月9日以降の残り所要	
積数	400
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

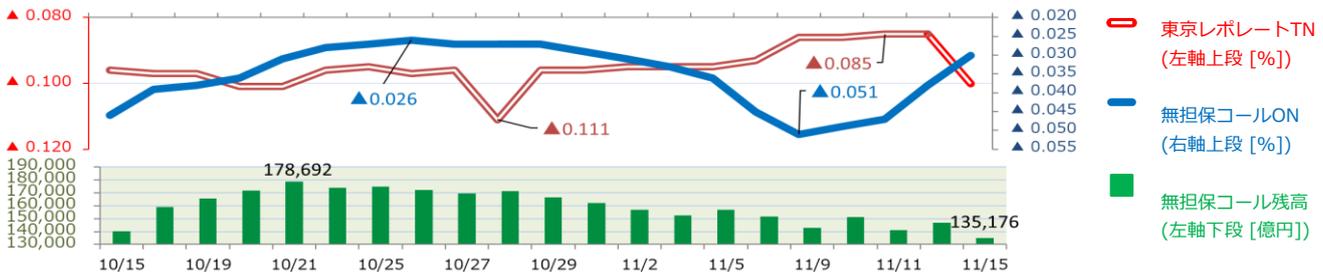
今月の国債買入オペ予定

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8日	2
3年超5年以下	4750	4,750	2 8 21 28	11月8日	2
5年超10年以下	5500	5,500	8 14 21 28	11月8日	3
10年超25年以下	2500	2,500	8 21 28	11月8日	2
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