



短期市場の推移

[億円] [%]

	11月2日	11月4日	11月7日	11月8日
加重平均金利	▲0.055	▲0.054	▲0.054	▲0.059
東京レボレート(TN)	▲0.087	▲0.085	▲0.085	▲0.085
無コール残	134,727	138,052	141,874	138,043
ON	72,790	74,865	79,667	75,736
その他	61,937	63,187	62,207	62,307
有コール残	30,844	31,195	31,372	29,400

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	0.001	▲0.063	▲0.085
T/N	-	-	-	▲0.085
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	▲0.063	▲0.089
2W	-	-	-	▲0.093
3W	-	-	-	▲0.101
1M	-	-	-	▲0.110
2M	-	-	-	-
3M	-	-	0.020	▲0.128
6M	-	-	-	▲0.138
1Y	-	-	-	▲0.132

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

日銀速報		日銀予想		当社需給予想		
11月9日		11月10日		11月11日		
券	+700		▲500		▲1,000	
財政	+200		▲17,600		+2,000	
過不足	+900		▲18,100		+1,000	
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		+18,000				
共通担保(全店)	▲10,300	+5,800				
CP等買入	▲100		▲100			
国債補充供給	+12,500	▲12,900	+12,900			
			</			

11月9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)(11/10~)					
5~10年	0	0			
5~10年	0	0			
国債補充供給(11/9~11/10)					
12,870	12,870	▲0.350	▲0.350		
0	0				

マネタリーベース [億円]

11月8日時点 6,161,900

所要

今積期の所要準備額 3,871,400

11月10日以降の残り所要

積数 300

平均 100

国庫短期証券入札予定

11月11日	3ヶ月(第1120回)
11月17日	1年
11月18日	3ヶ月
11月25日	3ヶ月

国債入札予定

11月15日	5年
11月17日	20年
11月25日	40年
11月29日	2年

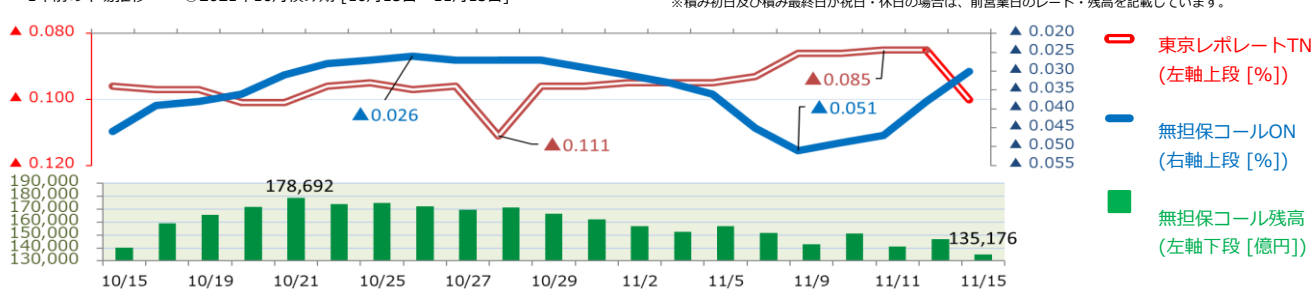
今月の国債買入オペ予定

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	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