



短期市場の推移

	11月4日	11月7日	11月8日	11月9日
加重平均金利	▲0.054	▲0.054	▲0.059	▲0.063
東京レポレート(TN)	▲0.085	▲0.085	▲0.085	▲0.085
無コール残	138,052	141,874	138,043	134,744
ON	74,865	79,667	75,736	71,437
その他	63,187	62,207	62,307	63,307
有コール残	31,195	31,372	29,400	30,729

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	▲0.066	▲0.084
T/N	▲0.070	▲0.050	▲0.063	▲0.087
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	▲0.065	▲0.089
2W	-	-	-	▲0.094
3W	-	-	-	▲0.101
1M	▲0.001	0.150	0.020	▲0.110
2M	-	-	-	-
3M	-	-	0.000	▲0.126
6M	-	-	-	▲0.135
1Y	-	-	-	▲0.132

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11日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	23:00 (米)11月ミシガン大学消費者信頼感指数速報	60.0
-	-	-	-
-	-	-	-

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▲0.068%の合出から始まり、その後は主に▲0.075%~▲0.065%の水準で取引された。昨日に引き続きビッドサイドの調達ニーズが限定的となり、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.003%の▲0.066%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.070 ~ ▲0.070	- ~ -	▲0.075 ~ ▲0.065

翌営業日のマーケット

週末3日積みではあるものの、出合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10日	11月11日	11月11日	11月12日	11月14日	11月15日
券	▲400	+300		+1,000		
財政	▲18,700	+800		▲5,000		
過不足	▲19,100	+1,100		▲4,000		
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
CP等買入	▲100	▲500				
国債補充供給	+12,900	▲11,700	+11,700			
当座預金増減	▲18,000	+12,300		▲4,000		
当座預金残高	4,903,200	4,915,500		4,911,500		
準備預金残高	4,270,200					
積み終了先	4,270,100					
超過準備	4,270,100					
非準備先残高	633,000					
準備預金進捗率	99.9%					
平均	83.9%					
乖離率	16.0%					

11月10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)(11/11~)						
5~10年	0	0				
5~10年	0	0				
CP等買入(11/15~)						
	4,000	7,158	3,965	0.001	0.021	78.2
国債補充供給(11/10~11/11)						
	11,719	11,719	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マネタリーベース (億円)
11月9日時点 6,176,200

所要 (億円)
今積期の所要準備額 3,871,400
11月11日以降の残り所要
積数 200
平均 0

国債短期証券入札予定

11月11日	3ヶ月(第1120回)
11月17日	1年(第1121回)
11月18日	3ヶ月
11月25日	3ヶ月

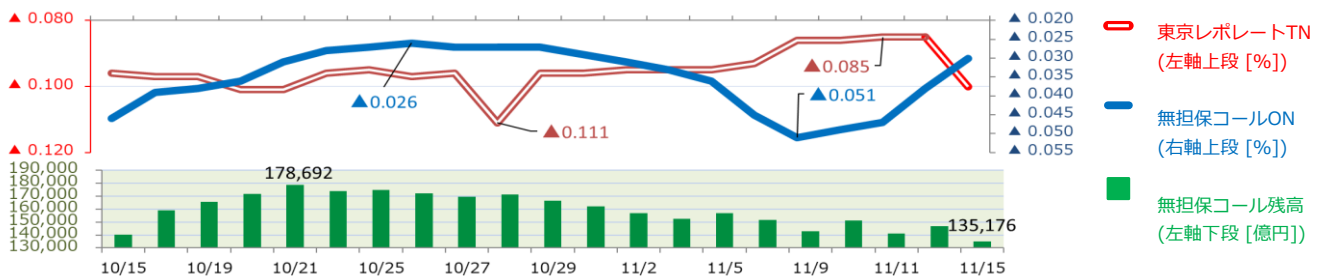
今月の国債買入オペ予定

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