



短期市場の推移

	11月7日	11月8日	11月9日	11月10日
加重平均金利	▲0.054	▲0.059	▲0.063	▲0.066
東京レポレート(TN)	▲0.085	▲0.085	▲0.085	▲0.087
無コール残	141,874	138,043	134,744	134,518
ON	79,667	75,736	71,437	72,411
その他	62,207	62,307	63,307	62,107
有コール残	31,372	29,400	30,729	30,950

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	▲0.083	0.001	▲0.068	▲0.085
T/N	-	-	-	▲0.084
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.070	0.008	▲0.048	▲0.089
2W	▲0.060	▲0.020	▲0.058	▲0.096
3W	-	-	-	▲0.101
1M	-	-	0.045	▲0.109
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.125
6M	-	-	-	▲0.133
1Y	-	-	-	▲0.131

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14日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	(米) NY連銀総裁の講演	-
-	-	米中首脳会談(バリ島)	-
-	-	-	-

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%の出合から始まり、その後は主に▲0.075%~▲0.065%の水準で取引された。3日積みもビッドサイドの調達意欲は高まらず、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.002%の▲0.068%となった。

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

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11日	11月14日	11月14日	11月15日	11月15日	11月15日
券	+200	+700	+700	+1,000	+1,000	+1,000
財政	▲800	▲2,900	▲2,900	▲3,000	▲3,000	▲3,000
過不足	▲600	▲2,200	▲2,200	▲4,000	▲4,000	▲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	▲500	▲200	▲200	-	-	-
国債補充供給	+11,700	▲12,400	+12,400	-	-	+4,000
当座預金増減	▲1,800	+10,000	+10,000	+0	+0	+0
当座預金残高	4,901,400	4,911,400	4,911,400	4,911,400	4,911,400	4,911,400
準備預金残高	4,269,700	4,269,700	4,269,700	4,269,700	4,269,700	4,269,700
積み終了先	4,269,700	4,269,700	4,269,700	4,269,700	4,269,700	4,269,700
超過準備	4,269,700	4,269,700	4,269,700	4,269,700	4,269,700	4,269,700
非準備先残高	631,700	631,700	631,700	631,700	631,700	631,700
準備預金進捗率	99.9%	99.9%	99.9%	99.9%	99.9%	99.9%
平均	93.5%	93.5%	93.5%	93.5%	93.5%	93.5%
乖離率	6.4%	6.4%	6.4%	6.4%	6.4%	6.4%
主な需給要因	源泉所得税場げ 社会保障費支払い 個人向け国債発行・償還		個人向け国債発行・償還		個人向け国債発行・償還	
	国庫短期証券発行・償還(3M)		国庫短期証券発行・償還(3M)		国庫短期証券発行・償還(3M)	
	流動性供給		流動性供給		流動性供給	

11月11日のオペ結果

オペア種別 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)(11/14~)

5~10年	0	0
5~10年	0	0

国債補充供給(11/11~11/14)

12,335	12,335	▲0.350	▲0.350
50	50	▲0.350	▲0.350

マネタリーベース

11月10日時点	6,158,600
----------	-----------

所要

今積期の所要準備額	3,871,400
11月14日以降の残り所要	積数 100
	平均 0

国庫短期証券入札予定

11月17日	1年(第1121回)
11月18日	3ヶ月(第1122回)
11月25日	3ヶ月
12月2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

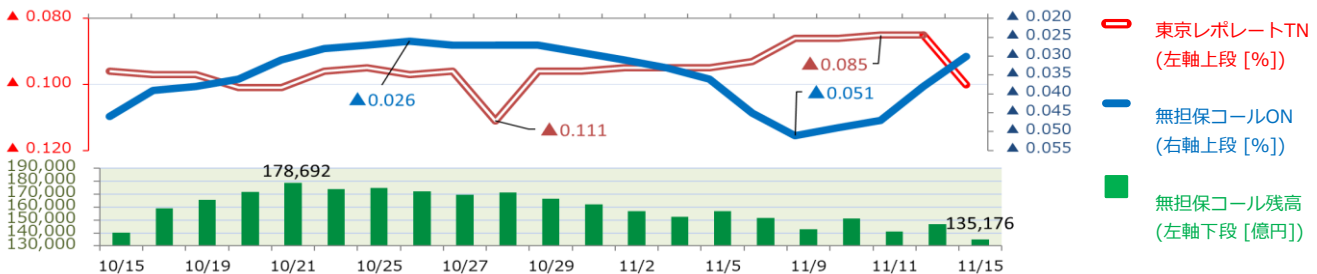
今月の国債買入オペ予定

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