



短期市場の推移

	11月8日	11月9日	11月10日	11月11日
加重平均金利	▲0.059	▲0.063	▲0.066	▲0.068
東京レボレート(TN)	▲0.085	▲0.085	▲0.087	▲0.084
無コール残	138,043	134,744	134,518	138,493
ON	75,736	71,437	72,411	76,336
その他	62,307	63,307	62,107	62,157
有コール残	29,400	30,729	30,950	30,998

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	▲0.085	0.001	▲0.067	▲0.084
T/N	-	-	▲0.060	▲0.085
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.067	0.008	▲0.063	▲0.091
2W	▲0.065	▲0.052	▲0.061	▲0.096
3W	-	-	-	▲0.102
1M	▲0.070	▲0.065	▲0.068	▲0.110
2M	-	-	-	-
3M	-	-	0.025	▲0.127
6M	-	-	-	▲0.133
1Y	-	-	-	▲0.131

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15日の予定 (時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
8:50	7-9月期国内総生産(GDP)速報[前期比年率]	+1.2%	22:30	(米)10月生産者物価コア指数[前年比]	7.2%
	-			-	
	-			-	

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。ビッドサイドの動きは前営業日と大きく変わらず、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.001%の▲0.067%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.075 ~ ▲0.073	- ~ -	▲0.070 ~ ▲0.065

翌営業日のマーケット

オファー・ビッドともに大きく変わらず、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14日	11月15日	11月15日	11月16日	11月16日	11月17日
券		+700		+700		+0
財政		▲600		+3,000		▲28,000
過不足		+100		+3,700		▲28,000
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
国債買入				+12,000		
CP等買入	▲200		▲300	+4,000		
国債補完供給	+12,400	▲12,400	+12,400			
当座預金増減		▲100		+31,800		▲28,000
当座預金残高		4,901,300		4,933,100		4,905,100
準備預金残高		4,288,700		4,288,700		4,288,700
積み終了先		4,288,700		4,288,700		4,288,700
超過準備		4,288,700		4,288,700		4,288,700
非準備預金残高		612,600		612,600		612,600
準備預金進捗率		100.0%		100.0%		100.0%
平均乖離率		96.8%		96.8%		96.8%
乖離率		3.2%		3.2%		3.2%

11月14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)(11/15~)						
5~10年	0	0				
5~10年	0	0				
国債買入(11/15~)						
1~3年	4,750	16,850	4,754	0.002	0.003	48.9
5~10年	5,500	14,332	5,513	0.006	0.009	71.5
25年~	1,000	2,301	1,004	0.032	0.034	28.3
物価連動	600	2,682	600	▲0.300	▲0.391	39.7
国債補完供給(11/14~11/15)						
12,339	12,339	▲0.350	▲0.350			
9	9	▲0.350	▲0.357			

マネタリーベース [億円]
 11月11日時点 6,156,600

所要	所要
今積期の所要準備額	3,871,400
11月15日以降の残り所要	
積数	0
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

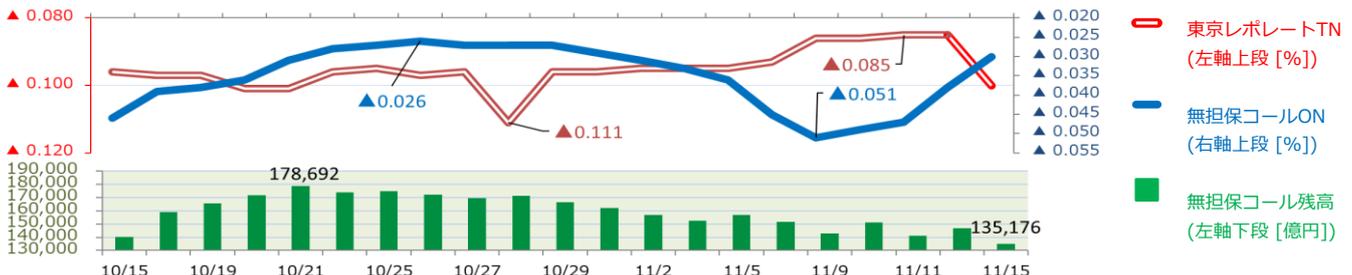
今月の国債買入オペ予定

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14日	1
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14日	2
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14日	1
物価連動債	600	600	月1回	11月14日	0
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