



### 短期市場の推移

	10月28日	10月31日	11月1日	11月2日
加重平均金利	▲0.052	▲0.062	▲0.057	▲0.055
東京レボレート(TN)	▲0.091	▲0.088	▲0.087	▲0.087
無コール残	136,688	132,452	132,572	134,727
ON	71,702	72,655	71,485	72,790
その他	64,986	59,797	61,087	61,937
有コール残	33,203	29,360	30,899	30,844

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	▲0.054	▲0.084
T/N	-	-	-	▲0.085
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.060	0.008	▲0.058	▲0.089
2W	-	-	▲0.058	▲0.096
3W	-	-	-	▲0.102
1M	▲0.055	0.050	▲0.040	▲0.108
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.134
6M	-	-	-	▲0.140
1Y	-	-	-	▲0.134

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7日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	(独)9月鉱工業生産指数[前月比]	-0.2%
-	-	-	-
-	-	-	-

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▲0.055%の合出から始まり、その後は主に▲0.058%~▲0.053%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さほど高まらず、レートの上昇は限定的であり、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.001%の▲0.054%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.058 ~ ▲0.058	- ~ -	▲0.060 ~ ▲0.050

### 翌営業日のマーケット

3日積み要因剥落もあり調達ニーズは軟調となると思われるため、出合水準は本日対比低下を想定。

### 資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想
	11月4日	11月7日	11月7日	11月8日	11月8日
券	▲300	+600	+600	+0	+0
財政	+1,000	▲5,900	▲5,900	▲2,000	▲2,000
過不足	+700	▲5,300	▲5,300	▲2,000	▲2,000
金融調節	エンド	スタート	エンド	スタート	スタート
国債買入			+700		
CP等買入	▲300	▲200			
国債補完供給	+12,500	▲12,700	+12,700		
当座預金増減	+12,300	+7,900	+7,900	▲2,000	▲2,000
当座預金残高	4,913,400	4,921,300	4,921,300	4,919,300	4,919,300
準備預金残高	4,281,900				
積み終了先	4,281,700				
超過準備	4,281,700				
非準備先残高	631,500				
準備預金進捗率	100.0%				
平均	71.0%				
乖離率	29.0%				

### 11月4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)(11/7~)						
5~10年	688	688				
5~10年	0	0				
国債補完供給(11/4~11/7)						
	12,633	12,633	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マネタリーベース 【億円】  
11月2日時点 6,157,400

所要	【億円】
今積期の所要準備額	3,874,800
11月7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
11月7日	物価連動
11月9日	30年
11月15日	5年
11月17日	20年

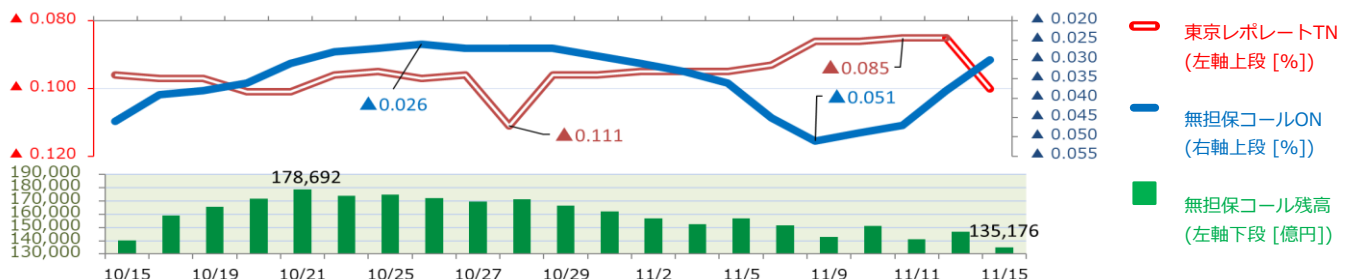
### 今月の国債買入オペ予定

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2日	3
3年超5年以下	4750	4,750	2 8 21 28	11月2日	3
5年超10年以下	5500	6,500	8 14 21 28	10月26日	4
10年超25年以下	2500	3,500	8 21 28	10月26日	3
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