



短期市場の推移

	10月30日	10月31日	11月1日	11月5日
加重平均金利	0.227	0.227	0.227	0.227
東京レボレート(TN)	0.143	0.234	0.240	0.238
無コール残	78,109	76,588	79,508	82,693
ON	29,844	28,453	29,853	32,818
その他	48,265	48,135	49,655	49,875
有コール残	36,498	34,869	36,705	37,387

11月7日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
		(米) FOMC (2日目)	
		パウエルFRB議長の会見	
		(欧) 小売売上高 (9月)	

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	0.220	0.228	0.227	0.240
T/N	-	-	-	0.233
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	0.226	0.204
2W	0.227	0.280	0.236	0.204
3W	-	-	-	0.204
1M	-	-	0.280	0.207
2M	-	-	-	-
3M	-	-	0.390	0.241
6M	-	-	-	0.302
1Y	-	-	-	0.356

本日の市況

無担保コールON物は0.227%の出合から始まり、その後は主に0.226%~0.227%を中心に取引された。ビットサイドの資金調達意欲は引き続き底堅く、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比横ばいの0.227%となった。

都銀・信託	証券	地銀
- ~ -	0.227 ~ 0.227	0.226 ~ 0.227

翌営業日のマーケット

ビットサイドの資金調達意欲は引き続き旺盛であるため、出合の水準は本日対比横ばい圏を予想する。

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6日	11月7日	11月7日	11月8日	11月8日
券		+500	▲100	+1,000	+1,000
財政		+500	▲2,900	▲26,000	▲26,000
過不足		+1,000	▲2,000	▲25,000	▲25,000
金融調節	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド
国債買入			+8,700		
CP等買入	▲500		▲100		
国債補完供給	+8,200	▲9,300	+9,300		
当座預金増減		▲600	+14,900	▲25,000	
当座預金残高		5,480,200	5,495,100	5,470,100	
準備預金残高		4,911,200			主な需給要因
積み終了先		4,910,800			国債発行(10年)
超過準備		4,910,700			
非準備預金先高		569,000			
準備預金進捗率		99.9%			
平均		71.0%			
乖離率		28.9%			

11月6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(11/7~)						
~1年	1,500	2,686	1,502	▲0.008	0.016	22.5
1~3年	3,250	10,382	3,255	▲0.007	▲0.004	27.7
3~5年	3,250	14,987	3,255	▲0.002	0.000	19.2
25年~	750	1,607	751	▲0.008	▲0.001	20.8
国債補完供給(11/6~11/7)						
11/6	9,552	9,552	▲0.050	▲0.050		
11/7	0	0				

マナタリーベース	所要
11月5日時点	6,724,200
今積期の所要準備額	4,041,000
11月7日以降の残り所要	
積数	500
平均	100

国庫短期証券入札予定

11月7日	6ヶ月(第1267回)
11月8日	3ヶ月(第1268回)
11月15日	3ヶ月
11月19日	1年
11月7日	10年
11月11日	物価連動
11月13日	30年
11月15日	5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	6		11月6日 0
1年超3年以下	3250	3,250	6	12 18 22	11月6日 3
3年超5年以下	3250	3,250	6	12 22 28	11月6日 3
5年超10年以下	3750	3,750	12	18 22 28	10月28日 4
10年超25年以下	1500	1,500	12	18 28	10月28日 3
25年超	750	750	6	22	11月6日 1
物価連動債	600	600	28		10月28日 1
変動利付債	-	300	-		4月14日 -

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