



短期市場の推移

	10月31日	11月1日	11月5日	11月6日
加重平均金利	0.227	0.227	0.227	0.227
東京レポレート(TN)	0.234	0.240	0.238	0.233
無コール残	76,588	79,508	82,693	82,931
ON	28,453	29,853	32,818	33,326
その他	48,135	49,655	49,875	49,605
有コール残	34,869	36,705	37,387	36,888

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	0.220	0.228	0.227	0.226
T/N	-	-	-	0.231
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	-	0.204
2W	0.275	0.280	0.278	0.204
3W	-	-	-	0.204
1M	-	-	0.290	0.207
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	0.243
6M	-	-	-	0.308
1Y	-	-	-	0.359

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8日の予定 (時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
14:00	8月の景気動向指数速報		-	
14:00	9月の消費活動指数		-	
15:00	10月のコール市場残高		-	

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。ビッド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

ビッド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。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	11月7日	11月8日	11月8日	11月11日	11月11日	11月11日
券	+0	+200	+200	+0	+0	+0
財政	▲3,700	▲22,400	▲22,400	+12,000	+12,000	+12,000
過不足	▲3,700	▲22,200	▲22,200	+12,000	+12,000	+12,000
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	+8,700					
CP等買入	▲100	▲600	▲600			
国債補完供給	+9,300	▲7,900	+7,900			
当座預金増減	+6,300	▲14,900	▲14,900	+12,000	+12,000	+12,000
当座預金残高	5,486,500	5,471,600	5,471,600	5,483,600	5,483,600	5,483,600
準備預金残高	4,916,500	主な需給要因				
積み終了先	4,916,400	国債発行(10年)	国庫短期証券発行・償還(3M-6M)			
超過準備	4,916,400					
非準備先残高	570,000					
準備預金進捗率	99.9%					
平均	74.2%					
乖離率	25.7%					

11月7日のオペ結果

[%][億円] ※米ドル資金供給は百万\$

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
国債補完供給(11/7~11/8)	8,090	8,090	▲0.050	▲0.050		
	0	0				

マネタリーベース [億円]

11月6日時点 6,723,100

所要

今積期の所要準備額	4,035,500
11月8日以降の残り所要	
積数	300
平均	0

国庫短期証券入札予定

入札日	3ヶ月(第1268回)
11月8日	3ヶ月
11月15日	1年
11月19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	6		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 -

国債入札予定

入札日	物価連動
11月11日	30年
11月13日	5年
11月15日	20年

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