



短期市場の推移

	11月6日	11月7日	11月8日	11月11日
加重平均金利	0.227	0.227	0.227	0.227
東京レボレート(TN)	0.233	0.231	0.235	0.237
無コール残	82,931	81,928	80,824	80,540
ON	33,326	33,013	30,414	30,390
その他	49,605	48,915	50,410	50,150
有コール残	36,888	37,162	37,266	39,661

[億円] [%]

11月13日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	(米) CPI (10月)	-
-	-	(欧) 鉱工業生産 (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	0.220	0.300	0.227	0.215
T/N	-	-	-	0.228
S/N	-	-	-	-
1W	0.231	0.390	0.281	0.207
2W	0.285	0.290	0.286	0.207
3W	-	-	-	0.207
1M	-	-	-	0.208
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	0.251
6M	-	-	-	0.314
1Y	-	-	-	0.375

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%~0.228%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12日	11月13日	11月13日	11月14日	11月14日
券		+200	+100	+0	+0
財政		▲6,500	+1,300	▲9,000	▲9,000
過不足		▲6,300	+1,400	▲9,000	▲9,000
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			▲11,600		
共通担保(全店)			▲8,000	+8,000	
CP等買入			▲200		
国債補充供給	+5,800	▲5,600	+5,600		
当座預金増減		▲6,100	+18,400	▲9,000	
当座預金残高		5,459,300	5,477,700	5,468,700	
準備預金残高		4,896,900	主な需給要因		
積み終了先		4,896,900	源泉所得税揚げ	国債発行(30年)	
超過準備		4,896,900			
非準備先残高		562,400			
準備預金進捗率		99.9%			
平均		90.3%			
乖離率		9.6%			

11月12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(11/13~)						
1~3年	3,250	9,804	3,253	0.003	0.003	95.5
3~5年	3,250	12,345	3,254	0.007	0.010	34.1
5~10年	3,750	7,856	3,756	0.004	0.006	69.9
10~25年	1,500	3,765	1,511	0.008	0.010	32.8
米ドル資金供給(11/14~11/21)						
	2	2	4,830	4,830		
国債補充供給(11/12~11/13)						
	5,768	5,768	▲0.050	▲0.050		
	0	0				
共通担保(全店)(11/13~11/27)						
	8,000	13,002	8,006		61.6	

マナタリベース [億円]
11月11日時点 6,707,600

所要	所要
今積期の所要準備額	4,035,500
11月13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15日	3ヶ月(第1269回)
11月19日	1年(第1270回)
11月22日	3ヶ月
11月29日	3ヶ月
国債入札予定	
11月13日	30年
11月15日	5年
11月21日	20年
11月27日	40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12日	2
3年超5年以下	3250	3,250	6 12 22 28	11月12日	2
5年超10年以下	3750	3,750	12 18 22 28	11月12日	3
10年超25年以下	1500	1,500	12 18 28	11月12日	2
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