

### 短期市場の推移

[億円] [%]

	10月31日	11月1日	11月5日	11月6日
加重平均金利	▲0.030	▲0.024	▲0.027	▲0.031
東京レポレート(ON)	▲0.064	▲0.064	▲0.079	▲0.102
無コール残	74,425	83,920	77,597	79,599
ON	53,760	60,905	53,577	56,604
その他	20,665	23,015	24,020	22,995
有コール残	19,814	19,851	19,851	18,331

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。

### 11月8日の予定 (時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
14:00頃	消費活動指数	-	(米)11月のシナリオ大消費者信頼感(速報)	
15:00	コール市場残高(10月)	-	(米)サンフランシスコ連銀 総裁の講演	
			(欧)EU財務相理事会	

経済指標及び予想値は株式会社フィスコ提供

### 本日の短期市場金利

### 本日の市況

	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	▲0.080	0.001	▲0.038	▲0.103
T/N	▲0.050	▲0.035	▲0.040	▲0.116
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.030	▲0.015	▲0.024	▲0.105
2W	-	-	-	▲0.101
3W	-	-	-	▲0.102
1M	-	-	-	▲0.104
2M	-	-	▲0.025	-
3M	-	-	-	▲0.124
6M	-	-	-	▲0.167
1Y	-	-	-	▲0.191

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

本日の無担保コールON物は▲0.035%の出合から始まり、その後は主に▲0.050%~▲0.025%の水準で取引された。昨日に引き続きビッドサイドの調達意欲が弱く、同加重平均金利(速報)は前日対比▲0.007%の▲0.038%と3営業日連続で低下した。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.050 ~ ▲0.045	▲0.040 ~ ▲0.035	▲0.045 ~ ▲0.025

### 翌営業日のマーケット

引き続きビッドサイドの調達意欲は弱く、出合いの水準は小幅低下を予想。

### 資金需給

[億円]

	日銀速報	日銀予想	当社需給予想
	11月7日	11月8日	11月11日
券	+0	+400	+1,000
財政	▲21,600	+1,400	▲14,000
過不足	▲21,600	+1,800	▲13,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国庫短期証券買入	+1,000		
共通担保(全店)		▲300	▲5,600
CP等買入			
当座預金増減	▲20,600	+1,500	▲18,600
当座預金残高	4,059,800	4,061,300	4,042,700
準備預金残高	3,514,900	主な需給要因	
積み終了先	3,514,700		
超過準備	3,514,700		
非準備預金残高	544,900		
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	接分
国債補完供給(11/7~11/8)		15	15	▲0.350	▲0.350	
		1	1	▲0.350	▲0.350	

### 国庫短期証券入札予定

### 今月の国債買入オペ予定

11月8日	3ヶ月	第869回
11月15日	3ヶ月	
11月19日	1年	
11月22日	3ヶ月	
11月8日	物価連動	
11月12日	30年	
11月14日	5年	
11月20日	20年	

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	100~1,000 程度	500	月2回程度	10月21日	2
1年超3年以下	3,000~5,500 程度	4,200			
3年超5年以下	2,000~4,500 程度	3,400	5 11 19 25	11月5日	3
5年超10年以下	2,000~5,000 程度	3,500	1 11 19 27	11月1日	3
10年超25年以下	500~2,000 程度	1,000			
25年超	0~500 程度	300	5 15 25	11月5日	2
物価連動債	300 程度	300	月2回程度	11月1日	1
変動利付債<偶数月>	1,000 程度	1,000	-	10月15日	-

マナタリーベース [億円]  
11月6日時点 5,203,800

所要 [億円]  
今積期の所要準備額 3,197,900  
11月8日以降の残り所要  
積数 1,500  
平均 200

### 1年前の市場推移

○2018年10月積み期 [10月16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。