

短期市場の推移

	10月29日	10月30日	10月31日	11月1日
加重平均金利	▲0.070	▲0.072	▲0.068	▲0.071
東京レポレート(ON)	▲0.129	▲0.134	▲0.125	▲0.139
無コール残	84,109	81,957	66,848	86,584
ON	50,344	49,212	34,528	54,064
その他	33,765	32,745	32,320	32,520
有コール残	14,186	14,219	11,652	14,035

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5日の予定(時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
8:50 金融政策決定会合 議事要旨 (9月18・19日分)	-	(米)10月の ISM非製造業指数	-
10:00 【挨拶】黒田総裁 (名古屋)	-	-	-
-	-	-	-

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

	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	▲0.086	0.001	▲0.071	▲0.115
T/N	-	-	▲0.010	▲0.142
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.046	0.000	▲0.032	▲0.143
2W	▲0.040	▲0.037	▲0.038	▲0.144
3W	-	-	-	▲0.144
1M	-	-	-	▲0.147
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.152
6M	-	-	-	▲0.152
1Y	-	-	-	▲0.159

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

本日の市況

無担保コールON物は▲0.085%の出合から始まった。その後は、主に▲0.086%~▲0.040%の水準で取引された。3日積みではあったものの、ビッドサイドの慎重な調達姿勢は変わらず、同加重平均金利(速報値)は前営業日対比横ばいの▲0.071%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.086 ~ ▲0.086	▲0.085 ~ ▲0.085	▲0.086 ~ ▲0.055

翌営業日のマーケット

ビッドサイドの慎重な調達姿勢は明日も継続し、本日と同様の軟調な地合を予想する。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	11月2日	11月5日	11月5日	11月6日	11月6日	11月6日
券	▲400	+1,000	+1,000	+1,000	+1,000	+1,000
財政	▲32,500	▲3,500	▲3,500	+3,000	+3,000	+3,000
過不足	▲32,900	▲2,500	▲2,500	+4,000	+4,000	+4,000
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	-	-	+12,200	-	-	-
共通担保(全店)	-	▲1,500	+1,800	-	-	-
CP等買入	▲100	▲100	-	-	-	-
ETF買入	+100	-	-	-	-	-
国債補完供給	+900	▲200	+200	-	-	-
当座預金増減	▲32,200	+10,100	+10,100	+4,000	+4,000	+4,000
当座預金残高	3,908,100	3,918,200	3,918,200	3,922,200	3,922,200	3,922,200
準備預金残高	3,426,800	3,426,800	3,426,800	3,426,800	3,426,800	3,426,800
積み終了先	3,426,200	3,426,200	3,426,200	3,426,200	3,426,200	3,426,200
超過準備	3,426,200	3,426,200	3,426,200	3,426,200	3,426,200	3,426,200
非準備預金残高	481,300	481,300	481,300	481,300	481,300	481,300
準備預金進捗率	99.9%	99.9%	99.9%	99.9%	99.9%	99.9%
平均	64.5%	64.5%	64.5%	64.5%	64.5%	64.5%
乖離率	35.4%	35.4%	35.4%	35.4%	35.4%	35.4%

11月2日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	接分
国債買入(11/5~)						
1~3年	3,500	10,063	3,505	▲0.006	▲0.004	22.2
3~5年	4,000	10,434	4,005	▲0.004	▲0.003	95.4
5~10年	4,500	10,978	4,505	▲0.006	▲0.004	29.5
国債補完供給(11/2~11/5)						
共通担保(全店)	73,434	190	190	▲0.600	▲0.600	
国債補完供給(11/5~11/19)						
共通担保(全店)	8,000	1,763	1,763			

マナタリーベース(億円)	所要(億円)
11月1日時点 5,039,700	今積期の所要準備額 3,102,700
	11月5日以降の残り所要積数 3,200
	平均 300

国庫短期証券入札予定

11月8日	16ヶ月
11月9日	3ヶ月
11月16日	3ヶ月
11月19日	1年
11月6日	物価運動
11月13日	30年
11月15日	5年
11月20日	20年

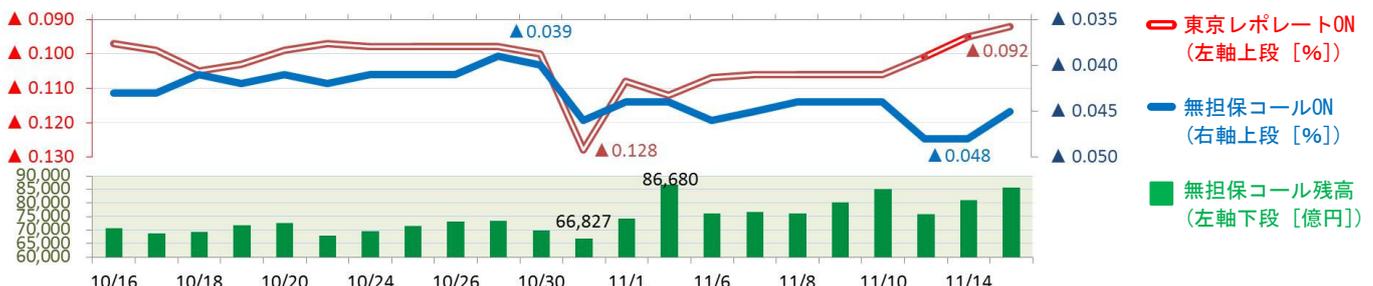
今月の国債買入オペ予定

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	100~1,000 程度	500	月2回程度	10月24日	2				
1年超3年以下	2,500~4,500 程度	3,500	2	9	19	28	11月2日	3	
3年超5年以下	3,000~5,500 程度	4,000	2	12	16	26	30	11月2日	4
5年超10年以下	3,000~6,000 程度	4,500	5	9	16	26	30	10月30日	5
10年超25年以下	1,500~2,500 程度	1,800							
25年超	100~1,000 程度	500							
物価運動債	250 程度	250	月2回程度	10月19日	2				
変動利付債<偶数月>	1,000 程度	1,000	1回	10月17日	1				

1年前の市場推移

○2017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。 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