

短期市場の推移

[億円][%]

11月14日の予定(時刻は日本時間)

	11月7日	11月8日	11月9日	11月12日
加重平均金利	▲0.070	▲0.071	▲0.071	▲0.070
東京レポレート(ON)	▲0.122	▲0.114	▲0.128	▲0.149
無コール残	76,207	84,738	85,934	82,088
ON	42,017	43,118	43,044	46,298
その他	34,190	41,620	42,890	35,790
有コール残	14,983	20,062	13,498	15,131

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。

	日本	予想	海外	予想	
8:50	7-9月期国内総生産(GDP)速報値[前期比年率]	▲0.9%	19:00	(欧)7-9月期域内総生産(GDP)改定値[前年比]	1.7%
13:30	9月第3次産業活動(経産省)	-	22:30	(米)10月消費者物価コア指数[前年比]	2.2%
13:30	9月鉱工業生産確報(経産省)	-	-	(米)パウエルFRB議長がダラス連銀の討論会に参加	-

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	▲0.072	▲0.200
T/N	-	-	▲0.015	▲0.256
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.045	0.000	▲0.034	▲0.202
2W	▲0.040	▲0.010	▲0.023	▲0.192
3W	-	-	-	▲0.182
1M	-	-	-	▲0.174
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.164
6M	-	-	-	▲0.156
1Y	-	-	-	▲0.160

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▲0.086%の出合から始まった。前日と同様に軟調な地合となり、その後は主に▲0.086%~▲0.050%の水準で取引された。同加重平均金利(速報値)は前営業日対比▲0.002%の▲0.072%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.086 ~ ▲0.086	▲0.086 ~ ▲0.086	▲0.086 ~ ▲0.050

翌営業日のマーケット

ビッドサイドの調達姿勢は変わらず、軟調な地合が継続すると予想する。

資金需給

[億円]

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	11月13日	11月14日	11月14日	11月15日	11月15日	11月16日
券		+300	+1,000	▲1,000	▲1,000	
財政		▲2,000	▲7,600	+8,000	+8,000	
過不足		▲1,700	▲6,600	+7,000	+7,000	
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
国庫短期証券買入				+1,000		
国債買入		+4,900				
CP等買入	▲600		▲500			
ETF買入				+1,100		
国債補完供給	+2,800	▲1,500	+1,500			
当座預金増減		+3,900	▲3,500		+7,000	
当座預金残高		3,921,500	3,918,000		3,925,000	
準備預金残高		3,421,500				
積み終了先		3,421,400				
超過準備		3,421,400				
非準備預金残高		500,000				
準備預金進捗率		99.9%				
平均		93.5%				
乖離率		6.4%				

11月13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
国庫短期証券買入(11/14~)	1,000	7,876	1,000	0.020	0.025	27.6
CP等買入(11/16~)	2,000	3,675	1,997	▲0.004	0.001	60.0
国債補完供給(11/13~11/14)	46,328	1,425	1,425	▲0.600	▲0.600	

マナタリーベース [億円]	所要 [億円]
11月12日時点 5,013,900	今積期の所要準備額 3,105,100
	11月14日以降の残り所要積数 300
	平均 100

国庫短期証券入札予定

今月の国債買入オペ予定

11月16日	3ヶ月	第796回
11月19日	1年	第797回
11月22日	3ヶ月	
11月30日	3ヶ月	
国債入札予定		
11月15日	5年	
11月20日	20年	
11月27日	40年	
11月29日	2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	11月5日	1
1年超3年以下	2,500~4,500 程度	3,500			
3年超5年以下	3,000~5,500 程度	4,000	2 9 19 28	11月9日	2
5年超10年以下	3,000~6,000 程度	4,500	2 12 16 26 30	11月12日	3
10年超25年以下	1,500~2,500 程度	1,800			
25年超	100~1,000 程度	500	5 9 16 26 30	11月9日	3
物価連動債	250 程度	250	月2回程度	11月12日	1
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