



短期市場の推移

	10月28日	10月29日	10月30日	10月31日
加重平均金利	0.477	0.477	0.476	0.477
東京レボレート(TN)	0.496	0.495	0.481	0.497
無コール残	79,098	76,334	76,093	72,112
ON	26,085	26,651	26,840	27,973
その他	53,013	49,683	49,253	44,139
有コール残	27,485	27,921	27,316	26,284

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	0.450	0.478	0.476	0.496
T/N	-	-	-	0.496
S/N	-	-	-	-
1W	0.486	0.560	0.517	0.491
2W	0.470	0.495	0.482	0.491
3W	-	-	0.550	0.491
1M	0.520	0.550	0.531	0.492
2M	0.580	0.585	0.583	-
3M	-	-	0.600	0.568
6M	-	-	-	0.629
1Y	-	-	-	0.738

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

[億円]

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	11月4日		11月5日		11月6日	
券	▲200		+700		+0	
財政	▲25,700		+1,200		▲26,000	
過不足	▲25,900		+1,900		▲26,000	
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
CP等買入	▲100		▲100		▲100	
国債補充供給	+1,600	▲4,100	+4,100			
当座預金増減	▲28,400		+5,900		▲26,000	
当座預金残高	4,948,700		4,950,500		4,924,500	
準備預金残高	4,522,100		4,522,100		4,522,100	
積み終了先	4,522,100		4,522,100		4,522,100	
超過準備	4,522,100		4,522,100		4,522,100	
非準備先残高	426,600		426,600		426,600	
準備預金進捗率	99.9%		99.9%		99.9%	
平均	64.5%		64.5%		64.5%	
乖離率	35.4%		35.4%		35.4%	

国庫短期証券入札予定

11月6日	6ヶ月(第1342回)
11月7日	3ヶ月(第1343回)
11月14日	3ヶ月
11月19日	1年

国債入札予定

11月5日	10年
11月11日	30年
11月13日	5年
11月17日	物価連動

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	1000	1,000	6	12	20	27		10月8日	1
1年超3年以下	3000	3,000	6	12	20	27		10月22日	3
3年超5年以下	2800	2,800	6	12	20	27		10月22日	3
5年超10年以下	3050	3,050	12	20	27			10月16日	3
10年超25年以下	1150	1,150	6	12	27			10月22日	3
25年超	750	750	6	20				10月16日	2
物価連動債	500	500	27					10月28日	1
変動利付債	-	300						4月14日	-

11月5日の予定(時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
8:50	日銀金融政策決定会合議事要旨(9月18~19日開催)		(米)ADP雇用統計(10月)	
8:50	マネタリーベース(10月)		(米)サービス業PMI(確報)(10月)	
	-		(欧)サービス業PMI(確報)(10月)	

本日の市況

無担保コールON物は0.477%の出合から始まり、その後も同程度で推移した。ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.001%の0.476%となった。

都銀・信託	証券	地銀
- ~ -	0.477 ~ 0.477	0.477 ~ 0.477

翌営業日のマーケット

出合いの水準は本日対比横ばい圏を予想する。

[%][億円]※米ドル資金供給は百万\$

11月4日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
------	------	----	----	----	----	----

国債補充供給(11/4~11/5)

3,378	3,378	0.250	0.250
1,000	1,000	0.250	0.250

米ドル資金供給(11/6~11/14)

1	1	4.130	4.130
---	---	-------	-------

米ドル資金供給用担保国債供給(11/5~11/17)

5,000	2	2	0.470	0.470
-------	---	---	-------	-------

マネタリーベース [億円]

10月31日時点	6,191,900
----------	-----------

所要

今積期の所要準備額	4,104,100
11月5日以降の残り所要	
積数	400
平均	0

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