



短期市場の推移

	10月30日	10月31日	11月4日	11月5日
加重平均金利	0.476	0.477	0.476	0.477
東京レボレート(TN)	0.481	0.497	0.496	0.496
無コール残	76,093	72,112	76,048	79,932
ON	26,840	27,973	30,074	30,249
その他	49,253	44,139	45,974	49,683
有コール残	27,316	26,284	28,290	26,568

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	0.530	0.477	0.494
T/N	-	-	-	0.495
S/N	-	-	-	-
1W	0.535	0.650	0.564	0.491
2W	0.483	0.640	0.536	0.491
3W	-	-	-	0.491
1M	0.540	0.580	0.560	0.493
2M	-	-	-	-
3M	-	-	0.700	0.572
6M	-	-	-	0.632
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6日		11月7日		11月10日	
券	+0		+600		+1,000	
財政	▲26,400		▲2,400		▲6,500	
過不足	▲26,400		▲1,800		▲5,500	
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				+8,300		
CP等買入			▲100			
国債補完供給	+1,800	▲400	+400			

国庫短期証券入札予定

11月7日	3ヶ月(第1343回)
11月14日	3ヶ月
11月19日	1年
11月21日	3ヶ月
国債入札予定	
11月11日	30年
11月13日	5年
11月17日	物価連動
11月19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	1000	1,000	6	12	20			11月6日	0
1年超3年以下	3000	3,000	6	12	20			11月6日	2
3年超5年以下	2800	2,800	6	20	27			11月6日	2
5年超10年以下	3050	3,050	12	20	27			10月28日	3
10年超25年以下	1150	1,150	6	12	27			11月6日	2
25年超	750	750	6	20				11月6日	1
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7日の予定(時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-		(米)雇用統計(10月) (発表延期の可能性も)	
-		(米)ミシガン大消費者信頼感指数(速報)(11月)	
-		(米)ジェファソンFRB副議長の講演	

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)は前営業日対比横ばいの0.477%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6日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
国債補完供給(11/6~11/7)						
	423	423	0.250	0.250		
	6	6	0.250	0.250		
国債買入(11/7~)						
~1年	1,000	4,439	1,003	0.021	0.023	84.9
1~3年	3,000	5,268	3,002	0.000	0.003	31.1
3~5年	2,800	10,273	2,801	0.008	0.009	34.0
10年~25年	1,150	3,534	1,154	0.011	0.015	44.3
25年~	750	2,252	756	0.015	0.020	65.1

マネタリーベース [億円]

11月5日時点 6,164,400

所要

今積期の所要準備額	4,104,100
11月7日以降の残り所要	
積数	200
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