



短期市場の推移

[億円] [%]

	10月31日	11月4日	11月5日	11月6日
加重平均金利	0.477	0.476	0.477	0.477
東京レボレート(TN)	0.497	0.496	0.496	0.495
無コール残	72,112	76,048	79,932	81,450
ON	27,973	30,074	30,249	31,663
その他	44,139	45,974	49,683	49,787
有コール残	26,284	28,290	26,568	27,310

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重。

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	0.500	0.478	0.494
T/N	-	-	-	0.498
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	0.482	0.491
2W	0.471	0.550	0.487	0.491
3W	-	-	-	0.491
1M	-	-	0.550	0.494
2M	-	-	-	-
3M	0.610	0.640	0.630	0.574
6M	-	-	-	0.632
1Y	-	-	-	0.739

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7日	11月10日	11月10日	11月11日	11月11日	11月11日
券		+500	+600		+0	
財政		+1,700	▲8,000		+2,000	
過不足		+2,200	▲7,400		+2,000	
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		+8,300				
CP等買入	▲100					
国債補完供給	+400	▲1,000	+1,000			
当座預金増減		▲25,000	▲6,400		+2,000	
当座預金残高		4,935,200	4,928,800		4,930,800	
準備預金残高		4,508,200				
積み終了先		4,508,200				
超過準備		4,508,100				
非準備先残高		427,000				
準備預金進捗率		100.0%				
平均		80.6%				
乖離率		19.4%				

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	按分
国債補完供給(11/7~11/10)	1,009	1,009	0.250	0.250		
	0	0				

マナタリーベース [億円]
11月6日時点 6,139,300

所要	所要
今積期の所要準備額	4,100,400
11月10日以降の残り所要	
積数	0
平均	0

国庫短期証券入札予定

11月14日	3ヶ月(第1344回)
11月19日	1年
11月21日	3ヶ月
11月28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	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	-

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