



短期市場の推移

[億円] [%]

	11月5日	11月6日	11月7日	11月10日
加重平均金利	0.477	0.477	0.478	0.481
東京レボレート(TN)	0.496	0.495	0.498	0.498
無コール残	79,932	81,450	81,130	82,873
ON	30,249	31,663	29,013	30,976
その他	49,683	49,787	52,117	51,897
有コール残	26,568	27,310	27,221	27,244

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	0.495
T/N	-	-	-	0.497
S/N	-	-	-	-
1W	0.484	0.535	0.494	0.492
2W	0.470	0.550	0.494	0.491
3W	-	-	0.590	0.491
1M	-	-	0.550	0.494
2M	-	-	-	-
3M	-	-	0.650	0.574
6M	-	-	-	0.631
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11日	11月12日	11月12日	11月13日	11月13日	11月13日
券		+600		+500		+0
財政		▲4,100		+2,800		▲3,000
過不足		▲3,500		+3,300		▲3,000
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
共通担保(全店)		▲8,000		+8,000		
国債補充供給	+1,300	▲600	+600			
当座預金増減		▲2,800		+3,900		▲3,000
当座預金残高		4,925,700		4,929,600		4,926,600
準備預金残高		4,498,300				
積み終了先		4,498,300				
超過準備		4,498,300				
非準備先残高		427,400				
準備預金進捗率		100.0%				
平均		87.1%				
乖離率		12.9%				

11月11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(11/11~11/12)

626 626 0.250 0.250
1 1 0.250 0.250

共通担保(全店)(11/12~11/26)

8,000 16,815 8,006 47.6

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▲0.004%の0.477%となった。

都銀・信託

- ~ -

証券

0.477 ~ 0.477

地銀

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\$

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13日	5年
11月17日	物価連動
11月19日	20年
11月26日	40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	-

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