



短期市場の推移

	11月7日	11月10日	11月11日	11月12日
加重平均金利	0.478	0.481	0.477	0.479
東京レボ レート(TN)	0.498	0.498	0.497	0.495
無コール残	81,130	82,873	82,695	86,227
ON	29,013	30,976	30,298	32,320
その他	52,117	51,897	52,397	53,907
有コール残	27,221	27,244	28,191	28,216

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	-	-	-	0.496
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	0.550	0.492
2W	0.471	0.580	0.489	0.491
3W	-	-	-	0.491
1M	-	-	-	0.494
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	0.574
6M	-	-	-	0.632
1Y	-	-	-	0.743

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

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	11月13日	11月14日	11月13日	11月14日	11月13日	11月14日
券	▲300	+500			+1,000	
財政	▲1,000	▲27,400			▲4,000	
過不足	▲1,300	▲26,900			▲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
国債買入		+6,900				
共通担保(全店)	▲100				▲100	
国債補完供給	+900	▲900	+900			
当座預金増減	+5,500	▲26,000			▲3,100	
当座預金残高	4,931,400	4,905,400			4,902,300	
準備預金残高	4,505,100					
積み終了先	4,505,100					
超過準備	4,505,100					
非準備先残高	426,300					
準備預金進捗率	100.0%					
平均	93.5%					
乖離率	6.5%					

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(第1345回)
11月21日	3ヶ月
11月28日	3ヶ月

国債入札予定

11月17日	物価連動
11月19日	20年
11月26日	40年
11月28日	2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12日	1
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	11月12日	2
10年超25年以下	1150	1,150	6 12 27	11月12日	1
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14日の予定(時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-		(米) 小売売上高(10月)	
-		(米) PPI(10月)	
-		(欧) GDP (2次速報/7~9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▲0.002%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13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(11/13~11/14)	809	809	0.250	0.250		
	204	204	0.250	0.250		

マネタリーベース [億円]

11月12日時点 6,137,700

所要

今積期の所要準備額	4,100,400
11月14日以降の残り所要	
積数	0
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