



短期市場の推移

	11月18日	11月19日	11月20日	11月21日
加重平均金利	0.227	0.227	0.227	0.227
東京レボレート(TN)	0.234	0.238	0.238	0.224
無コール残	76,931	81,224	79,610	78,766
ON	28,451	31,974	31,680	30,046
その他	48,480	49,250	47,930	48,720
有コール残	39,433	40,148	40,078	39,979

[億円] [%]

11月25日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	-	-
-	-	-	-
-	-	-	-

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	0.210	0.228	0.227	0.223
T/N	-	-	-	0.238
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	0.295	0.212
2W	-	-	-	0.212
3W	-	-	0.290	0.212
1M	-	-	-	0.216
2M	-	-	-	-
3M	-	-	0.350	0.273
6M	-	-	-	0.357
1Y	-	-	-	0.418

本日の市況

無担保コールON物は0.227%の出合から始まり、その後は主に0.226%~0.227%を中心に取引された。ビッドサイドの資金調達意欲は引き続き底堅く、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比横ばいの0.227%となった。

都銀・信託	証券	地銀
- ~ -	0.227 ~ 0.227	0.226 ~ 0.227

翌営業日のマーケット

ビッドサイドの資金調達意欲は引き続き旺盛であるため、出合の水準は本日対比横ばい圏を予想する。

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22日	11月25日	11月25日	11月26日	11月26日	11月26日
券		▲500		▲400		▲1,000
財政		▲15,100		+18,200		▲8,000
過不足		▲15,600		+17,800		▲9,000
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				+11,000		
CP等買入	▲500		▲300			
国債補完供給	+5,300	▲4,800	+4,800			
当座預金増減		▲15,600		+33,300		▲9,000
当座預金残高		5,432,100		5,465,400		5,456,400
準備預金残高		4,880,000				
積み終了先		4,878,200				
超過準備		4,878,100				
非準備先残高		552,100				
準備預金進捗率		99.6%				
平均		30.0%				
乖離率		69.6%				

11月22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
国債買入(11/25~)						
1~3年	3,250	7,662	3,256	0.008	0.010	45.3
3~5年	3,250	8,126	3,255	0.000	0.003	70.7
5~10年	3,750	7,549	3,754	▲0.010	▲0.008	40.5
25年~	750	2,158	753	0.008	0.008	92.0
国債補完供給(11/22~11/25)						
		4,916	4,916	▲0.050	▲0.050	
		0	0			

マネタリーベース [億円]
11月21日時点 6,690,500

所要	所要
今積期の所要準備額	3,912,200
11月25日以降の残り所要	
積数	13,800
平均	700

国庫短期証券入札予定

11月29日	3ヶ月(第1272回)
12月6日	3ヶ月
12月9日	6ヶ月
12月13日	3ヶ月
国債入札予定	
11月27日	40年
11月29日	2年
12月3日	10年
12月5日	30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	1500	1,500	6	11月6日	0
1年超3年以下	3250	3,250	6 12 18 22	11月22日	0
3年超5年以下	3250	3,250	6 12 22 28	11月22日	1
5年超10年以下	3750	3,750	12 18 22 28	11月22日	1
10年超25年以下	1500	1,500	12 18 28	11月18日	1
25年超	750	750	6 22	11月22日	0
物価連動債	600	600	28	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