



短期市場の推移

	11月21日	11月22日	11月25日	11月26日
加重平均金利	0.227	0.227	0.227	0.228
東京レポレート(TN)	0.224	0.238	0.230	0.152
無コール残	78,766	77,239	76,641	79,867
ON	30,046	30,359	29,961	32,347
その他	48,720	46,880	46,680	47,520
有コール残	39,979	40,594	39,689	39,761

[億円] [%]

11月28日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
臨時国会召集		(米) 休場	
-		-	
-		-	

加重平均金利、コール残高は日銀、東京レポ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)			レポ市場
	最低	最高	平均	東京レポレート
O/N	0.220	0.275	0.228	0.158
T/N	-	-	-	0.150
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	0.226	0.181
2W	-	-	0.280	0.202
3W	-	-	0.300	0.208
1M	-	-	-	0.215
2M	-	-	-	-
3M	-	-	0.490	0.299
6M	-	-	-	0.363
1Y	-	-	-	0.430

本日の市況

無担保コールON物は0.227%の出合から始まり、その後は主に同水準を中心に取引された。ビット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0.228%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

ビット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、東京レポ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27日	11月28日	11月28日	11月29日	11月29日
券		▲800	▲1,200	▲300	▲300
財政		▲4,000	▲8,200	+8,000	+8,000
過不足		▲4,800	▲9,400	+7,700	+7,700
金融調節	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド
共通担保(全店)	▲8,000	+8,000			
CP等買入	▲300		▲100		+2,000
社債等買入			▲100		
国債補充供給	+7,400	▲7,500	+7,500		
当座預金増減		▲5,200	▲2,100	+9,700	
当座預金残高		5,431,500	5,429,400	5,439,100	
準備預金残高		4,876,700	主な需給要因		
積み終了先		4,875,100	国債発行(40年)		
超過準備		4,875,100			
非準備先残高		554,800			
準備預金進捗率		99.8%			
平均		40.0%			
乖離率		59.8%			

11月27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
国債補充供給(11/27~11/28)	7,680	7,680	▲0.050	▲0.050		
	11	11	▲0.050	▲0.050		

マネタリーベース [億円]

11月26日時点 6,681,400

所要

今積期の所要準備額 3,912,200

11月28日以降の残り所要	
積数	8,900
平均	500

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
11月29日	2年
12月3日	10年
12月5日	30年
12月10日	5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