



短期市場の推移

	11月22日	11月25日	11月26日	11月27日
加重平均金利	0.227	0.227	0.228	0.228
東京レボレート(TN)	0.238	0.230	0.152	0.150
無コール残	77,239	76,641	79,867	78,693
ON	30,359	29,961	32,347	31,682
その他	46,880	46,680	47,520	47,011
有コール残	40,594	39,689	39,761	39,510

[億円] [%]

11月29日の予定 (時刻は日本時間)

時刻	日本	予想	海外	予想
8:30	東京都部CPI (11月)		(欧) 消費者物価 (11月)	
8:30	失業率 (10月)		-	
8:30	有効求人倍率 (10月)		-	

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	0.215	0.275	0.228	0.197
T/N	-	-	-	0.145
S/N	-	-	-	-
1W	0.228	0.390	0.255	0.171
2W	-	-	-	0.200
3W	-	-	0.285	0.208
1M	-	-	0.530	0.216
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	0.304
6M	-	-	-	0.365
1Y	-	-	-	0.442

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28日	11月29日	11月29日	12月2日	
券	▲1,200	▲500	▲500	+0	
財政	▲8,500	+4,500	+4,500	▲43,000	
過不足	▲9,700	+4,000	+4,000	▲43,000	
金融調節	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド
国債買入			+8,900		
CP等買入	▲100		▲1,400	+2,000	
社債等買入	▲100		▲200		
国債補充供給	+5,600	▲4,100	+4,100		
成長基盤強化支援				▲1,700	
当座預金増減	▲8,400	+17,400	+17,400	▲44,700	
当座預金残高	5,423,100	5,440,500	5,440,500	5,395,800	
準備預金残高	4,866,300				主な需給要因
積み終了先	4,864,600				国債発行償還(2年)
超過準備	4,864,600				国庫短期証券発行償還(3M)
非準備先残高	556,800				
準備預金進捗率	99.8%				
平均	43.3%				
乖離率	56.5%				

11月28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(11/29~)						
3~5年	3,250	9,729	3,253	▲0.017	▲0.016	70.3
5~10年	3,750	9,575	3,756	▲0.019	▲0.017	82.9
10~25年	1,500	3,229	1,505	▲0.008	▲0.005	5.6
物価連動	600	1,555	600	0.180	0.013	55.0
国債補充供給(11/28~11/29)						
	4,273	4,273	▲0.050	▲0.050		
	0	0				

マネタリーベース

[億円] 11月27日時点 6,676,900

所要

今積期の所要準備額	所要
11月29日以降の残り所要	3,912,200
積数	7,200
平均	400

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28日 0
5年超10年以下	3750	3,750	12 18 22 28		11月28日 0
10年超25年以下	1500	1,500	12 18 28		11月28日 0
25年超	750	750	6 22		11月22日 0
物価連動債	600	600	28		11月28日 0
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