



短期市場の推移

[億円] [%]

	11月26日	11月27日	11月28日	11月29日
加重平均金利	0.228	0.228	0.228	0.227
東京レボレート(TN)	0.152	0.150	0.145	0.240
無コール残	79,867	78,693	78,863	82,181
ON	32,347	31,682	31,692	35,100
その他	47,520	47,011	47,171	47,081
有コール残	39,761	39,510	38,965	38,206

12月3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	0.285	0.227	0.234
T/N	-	-	-	0.240
S/N	-	-	-	-
1W	0.226	0.278	0.250	0.211
2W	-	-	0.227	0.212
3W	-	-	-	0.224
1M	-	-	0.430	0.252
2M	-	-	0.480	-
3M	-	-	0.460	0.324
6M	-	-	-	0.380
1Y	-	-	-	0.456

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0.227%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

[億円]

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	12月2日	12月3日	12月3日	12月4日	12月4日	12月4日
券		▲100	▲900	▲1,000		
財政		▲16,800	▲34,200	▲101,000		
過不足		▲16,900	▲35,100	▲102,000		
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
社債等買入	▲300					
国債補充供給	+4,700	▲5,900	+5,900			
成長基盤強化支援	▲1,500					
当座預金増減		▲19,900	▲29,200	▲102,000		
当座預金残高		5,411,400	5,382,200	5,280,200		
準備預金残高		4,846,900	主な需給要因			
積み終了先		4,845,700	法人税・消費税・保険			
超過準備		4,845,700	料揚げ			
非準備先残高		564,500	国債発行(10年)			
準備預金進捗率		99.9%				
平均		56.7%				
乖離率		43.2%				

12月2日のオペ結果

[%][億円] ※ミ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(12/2~12/3)	5,956	5,956	▲0.050	▲0.050		
	0	0				

マネタリーベース [億円]
11月29日時点 6,678,600

所要		[億円]
今積期の所要準備額		3,912,200
12月3日以降の残り所要		
積数		1,200
平均		100

国庫短期証券入札予定

12月6日	3ヶ月(第1273回)
12月9日	6ヶ月(第1274回)
12月13日	3ヶ月
12月18日	1年
国債入札予定	
12月3日	10年
12月5日	30年
12月10日	5年
12月17日	20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	
			4	9	13	20			
1年以下	1500	1,500	4				11月6日	1	
1年超3年以下	3250	3,250	4	9	13	20		11月22日	4
3年超5年以下	3250	3,250	4	13	20	25		11月28日	4
5年超10年以下	3750	3,750	9	13	20	25		11月28日	4
10年超25年以下	1500	1,500	4	13	20			11月28日	3
25年超	750	750	9	25				11月22日	2
物価連動債	600	600	25					11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