

短期市場の推移

[億円] [%]

	11月22日	11月26日	11月27日	11月28日
加重平均金利	▲0.071	▲0.070	▲0.073	▲0.070
東京レポレート(ON)	▲0.134	▲0.126	▲0.126	▲0.122
無コール残	89,992	80,786	84,394	78,868
ON	55,902	47,796	52,404	47,078
その他	34,090	32,990	31,990	31,790
有コール残	13,207	20,739	15,422	18,016

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・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)			レポ市場
	最低	最高	平均	東京レポレート
O/N	▲0.086	0.001	▲0.072	▲0.122
T/N	▲0.015	0.000	▲0.010	▲0.166
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.035	▲0.030	▲0.034	▲0.159
2W	▲0.035	▲0.033	▲0.034	▲0.159
3W	-	-	-	▲0.162
1M	-	-	-	▲0.165
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.165
6M	-	-	-	▲0.162
1Y	-	-	-	▲0.161

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

11月30日の予定(時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
8:30	10月失業率	+2.3%	23:45	(米)11月シカゴ購買部協会景気指数
8:30	10月有効求人倍率	1.65倍	19:00	(欧)10月失業率
-	【記者会見】政井審議委員(11月29日)	-	-	-

経済指標及び予想値は株式会社フィスコ提供

本日の市況

無担保コールON物は、▲0.086%の出合から始まった。その後は主に▲0.086%～▲0.050%の水準で取引された。同加重平均金利(速報値)は前営業日対比▲0.002%の▲0.072%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.086 ~ ▲0.086	▲0.086 ~ ▲0.086	▲0.086 ~ ▲0.050

翌営業日のマーケット

月末であるため一部金融機関が調達を見合わせる見込み。、地合は本日と大きく変わらないと予想。

資金需給

[億円]

	日銀速報	日銀予想	当社需給予想
	11月29日	11月30日	12月3日
券	▲1,600	▲600	▲1,000
財政	▲2,700	+5,100	▲27,000
過不足	▲4,300	+4,500	▲28,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国債買入	+7,900	スタート	スタート
共通担保(全店)	▲100	▲1,100	▲1,500
CP等買入	+300	+2,000	
ETF買入	▲1,100	+400	
国債補完供給			▲11,500
成長基盤強化支援			+4,100
当座預金増減	+2,700	+6,900	▲36,900
当座預金残高	3,909,700	3,916,600	3,879,700
準備預金残高	3,421,300	主な需給要因	
積み終了先	3,421,000		
超過準備	3,420,800		
非準備先残高	488,400		
準備預金進捗率	99.9%		
平均	46.7%		
乖離率	53.2%		

11月29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
国債補完供給(11/29~11/30)	157,935	996	996	▲0.600	▲0.600	
	15,091	62	62	▲0.600	▲0.600	

マネタリーベース

[億円]

11月28日時点 5,008,700

所要

[億円]

今積期の所要準備額 3,011,000

11月30日以降の残高所要

積数 3,300

平均 200

国庫短期証券入札予定

11月30日	3ヶ月	第799回
12月7日	6ヶ月	第800回
12月7日	3ヶ月	
12月14日	3ヶ月	
国債入札予定		
12月4日	10年	
12月11日	30年	
12月13日	5年	
12月18日	20年	

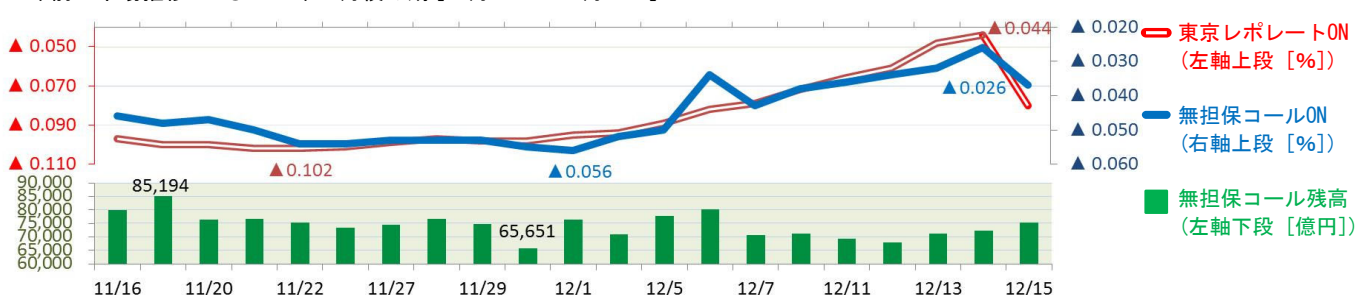
今月の国債買入オペ予定

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
1年以下	100~1,000 程度	500	月2回程度	11月19日	0
1年超3年以下	2,500~4,500 程度	3,500			
3年超5年以下	3,000~5,500 程度	4,000	2 9 19 28	11月28日	0
5年超10年以下	3,000~6,000 程度	4,500	2 12 16 26 30	11月26日	1
10年超25年以下	1,500~2,500 程度	1,800	5 9 16 26 30	11月26日	1
25年超	100~1,000 程度	500			
物価連動債	250 程度	250	月2回程度	11月28日	0
変動利付債<偶数月>	1,000 程度	1,000	1回	10月17日	-

1年前の市場推移

○2017年11月積み期 [11月16日~12月15日]

※積み初日及び積み最終日が祝日・休日の場合は、前営業日のレート・残高を記載しています。



本資料は投資環境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