



短期市場の推移

[億円] [%]

	11月18日	11月19日	11月20日	11月21日
加重平均金利	0.478	0.479	0.477	0.478
東京レポレート(TN)	0.498	0.498	0.501	0.504
無コール残	82,905	82,876	80,954	87,498
ON	29,879	30,273	29,161	35,585
その他	53,026	52,603	51,793	51,913
有コール残	28,051	28,188	27,523	27,243

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重。

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	0.450	0.530	0.478	0.498
T/N	-	-	-	0.502
S/N	-	-	-	-
1W	0.491	0.550	0.511	0.495
2W	0.471	0.481	0.476	0.494
3W	-	-	0.640	0.494
1M	-	-	-	0.497
2M	-	-	-	-
3M	-	-	0.700	0.583
6M	-	-	-	0.642
1Y	-	-	-	0.745

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25日		11月26日		11月27日	
券	▲600		+200		+0	
財政	+900		▲5,900		▲4,000	
過不足	+300		▲5,700		▲4,000	
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
共通担保(全店)			▲8,000		+8,000	
CP等買入	▲700					
社債等買入	▲300					
国債補完供給	+2,300		▲5,600		+5,600	
当座預金増減	▲4,000		▲100		▲4,000	
当座預金残高	4,895,000		4,894,900		4,890,900	
準備預金残高	4,506,700		主な需給要因			
積み終了先	4,505,300					
超過準備	4,505,200					
非準備先残高	388,300					
準備預金進捗率	99.7%					
平均	33.3%					
乖離率	66.4%					

国庫短期証券入札予定

11月28日	3ヶ月(第1347回)
12月5日	3ヶ月
12月9日	6ヶ月
12月12日	3ヶ月

国債入札予定

11月26日	40年
11月28日	2年
12月2日	10年
12月4日	30年

今月の国債買入オペ予定

オペ種類	一回当たりオペ金額	直近オペ金額	オペ予定日	直近日	残り回数
1年以下	1000	1,000	6	11月6日	0
1年超3年以下	3000	3,000	6 12 20	11月20日	0
3年超5年以下	2800	2,800	6 20 27	11月20日	1
5年超10年以下	3050	3,050	12 20 27	11月20日	1
10年超25年以下	1150	1,150	6 12 27	11月12日	1
25年超	750	750	6 20	11月20日	0
物価連動債	500	500	27	10月28日	1
変動利付債	-	300	-	4月14日	-

11月26日の予定(時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
14:00	基調的なインフレ率を捕捉するための指標(10月)		(米) ベージュブック		
	-		-		
	-		-		

本日の市況

無担保コールON物は0.477%の出合から始まり、その後も同程度で推移した。ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比横ばいの0.478%となった。

[%]

都銀・信託	証券	地銀
- ~ -	0.477 ~ 0.477	0.477 ~ 0.477

翌営業日のマーケット

出合いの水準は本日対比横ばい圏を予想する。

[%][億円]※米ドル資金供給は百万\$

11月25日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
------	------	----	----	----	----	----

国債補完供給(11/25~11/26)

5,281	5,281	0.250	0.250
626	626	0.250	0.250

共通担保(全店)(11/26~12/10)

8,000	16,690	8,006	48.0
-------	--------	-------	------

米ドル資金供給(11/27~12/4)

2	2	4.150	4.150
---	---	-------	-------

マネタリーベース [億円]

11月21日時点	6,111,700
----------	-----------

所要

[億円]

今積期の所要準備額	3,979,900
11月26日以降の残り所要	
積数	12,300
平均	600

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(登録)第243号 加入協会 日本証券業協会