



短期市場の推移

	11月21日	11月25日	11月26日	11月27日
加重平均金利	0.478	0.478	0.478	0.477
東京レボレート(TN)	0.504	0.502	0.502	0.495
無コール残	87,498	89,305	88,142	85,412
ON	35,585	37,097	35,324	34,834
その他	51,913	52,208	52,818	50,578
有コール残	27,243	27,226	26,322	28,131

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・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)			レボ市場
	最低	最高	平均	東京レボレート
O/N	0.445	0.525	0.477	0.498
T/N	-	-	-	0.500
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	0.530	0.495
2W	0.476	0.482	0.479	0.495
3W	-	-	-	0.495
1M	-	-	-	0.507
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	0.598
6M	-	-	-	0.646
1Y	-	-	-	0.747

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	
	11月28日		12月1日		12月2日	
券	▲400		▲500		+	
財政	▲13,900		▲33,400		▲80,000	
過不足	▲14,300		▲33,900		▲10,000	
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
国債買入	+7,300					
社債等買入	▲100	▲100				
国債補完供給	+1,500	+1,300	+1,300			

国庫短期証券入札予定

12月5日	3ヶ月(第1348回)
12月9日	6ヶ月
12月12日	3ヶ月
12月17日	1年

国債入札予定

12月2日	10年
12月4日	30年
12月9日	5年
12月11日	20年

来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	1000	1,000	3					11月6日	1
1年超3年以下	3000	3,000	3	10	17			11月20日	3
3年超5年以下	2800	2,800	3	17	24			11月27日	3
5年超10年以下	3050	3,050	10	17	24			11月27日	3
10年超25年以下	1150	1,150	3	17	24			11月27日	3
25年超	750	750	10	24				11月20日	2
物価連動債	500	500	24					11月27日	1
変動利付債	-	300						4月14日	-

12月1日の予定(時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
10:05	植田日銀総裁のあいさつ			(米) 製造業PMI(確報) (11月)	
	-			(米) ISM製造業指数	
	-			(欧) 製造業PMI(確報) (11月)	

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0.477%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28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(11/28~12/1)						
	1,183	1,183	0.250	0.250		
	210	210	0.250	0.250		

マネタリーベース [億円]

11月27日時点 6,091,400

所要

今積期の所要準備額	3,979,900
12月1日以降の残り所要 積数	5,300
平均	400

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