



短期市場の推移

	11月16日	11月17日	11月18日	11月21日
加重平均金利	▲0.070	▲0.071	▲0.071	▲0.072
東京レボレート(TN)	▲0.087	▲0.089	▲0.088	▲0.096
無コール残	121,678	129,534	133,932	129,962
ON	61,086	65,892	68,924	63,205
その他	60,592	63,642	65,008	66,757
有コール残	31,473	30,900	30,611	30,341

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	▲0.087	0.001	▲0.073	▲0.092
T/N	-	-	-	▲0.099
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	▲0.070	▲0.101
2W	-	-	▲0.075	▲0.107
3W	-	-	▲0.060	▲0.114
1M	-	-	-	▲0.121
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.128
6M	-	-	-	▲0.130
1Y	-	-	-	▲0.129

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

11月24日の予定 (時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
	-		(米)休場 (感謝祭)		-
	-		-		-
	-		-		-

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

本日の無担保コールON物は▲0.070%の合出から始まり、その後は主に▲0.075%~▲0.070%の水準で取引された。昨日同様に市場参加者の動向に大きな変化はなく、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.001%の▲0.073%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.085 ~ ▲0.085	- ~ -	▲0.080 ~ ▲0.070

翌営業日のマーケット

市場参加者に大きな動向変化はなく、出合の水準は本日対比横ばい圏を予想。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	11月22日	11月24日	11月24日	11月25日	11月25日	11月25日
券	▲500	▲900	▲900	▲1,000	▲1,000	▲1,000
財政	▲300	▲5,200	▲5,200	+48,000	+48,000	+48,000
過不足	▲800	▲6,100	▲6,100	+47,000	+47,000	+47,000
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
国庫短期証券買入				+1,000		
国債買入		+18,000				
共通担保(全店)			▲5,800	+1,500		
CP等買入	▲100		▲400			
社債等買入		+1,000				
国債補完供給	+9,200	▲10,200	+10,200			
当座預金増減	+17,100	+400	+400	+47,000	+47,000	+47,000
当座預金残高	4,915,700	4,916,100	4,916,100	4,963,100	4,963,100	4,963,100
準備預金残高	4,268,900	主な需給要因				
積み終了先	4,265,800	流動性供給	国庫短期証券			
超過準備	4,265,600		償還(6M)			
非準備先残高	646,800					
準備預金進捗率	99.5%					
平均	26.7%					
乖離率	72.8%					

11月22日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
国庫短期証券買入(11/24~)	1,000	7,428	1,002	0.006	0.007	52.9
国債買入(固定利回り方式)(11/24~)						
5~10年	0	0	0			
5~10年	0	0	0			
米ドル資金供給(11/25~12/1)						
0	0	4,090	4,090			
国債補完供給(11/22~11/24)						
10,059	10,059	▲0.350	▲0.350			
0	0					
共通担保(全店)(11/24~12/7)						
1,502	1,502					

マネタリーベース (億円) 11月21日時点 6,153,500

所要 今積期の所要準備額 3,767,900
 11月24日以降の残り所要
 積数 20,200
 平均 900

国庫短期証券入札予定

11月25日	3ヶ月(第1123回)
12月2日	3ヶ月
12月8日	6ヶ月
12月9日	3ヶ月

国債入札予定

11月25日	40年
11月29日	2年
12月1日	10年
12月6日	30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	月1回	11月2日	0
1年超3年以下	4750	4,750	2 8 14 21	11月21日	0
3年超5年以下	4750	4,750	2 8 21 28	11月21日	1
5年超10年以下	5500	5,500	8 14 21 28	11月21日	1
10年超25年以下	2500	2,500	8 21 28	11月21日	1
25年超	1000	1,000	2 14 28	11月14日	1
物価連動債	600	600	月1回	11月14日	0
変動利付債<四半期>	300	300	四半期に1回	10月17日	0

1年前の市場推移

○2021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