



短期市場の推移

[億円] [%]

	11月21日	11月22日	11月24日	11月25日
加重平均金利	▲0.072	▲0.073	▲0.073	▲0.075
東京レボレート(TN)	▲0.096	▲0.099	▲0.101	▲0.102
無コール残	129,962	141,342	132,235	137,926
ON	63,205	73,435	64,303	70,594
その他	66,757	67,907	67,932	67,332
有コール残	30,341	31,588	31,663	31,756

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	▲0.077	▲0.119
T/N	-	-	-	▲0.131
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.075	▲0.073	▲0.074	▲0.127
2W	▲0.075	▲0.068	▲0.072	▲0.126
3W	-	-	-	▲0.128
1M	-	-	-	▲0.132
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.139
6M	-	-	-	▲0.131
1Y	-	-	-	▲0.130

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	11月29日	11月30日
券	▲300	▲500	▲300
財政	▲9,100	▲5,100	+8,700
過不足	▲9,400	▲5,600	+8,400
金融調節	エンド	スタート	エンド
国債買入	▲100	+13,600	スタート
CP等買入	▲300	▲400	+4,000
社債等買入	▲300	▲500	-
国債補充供給	+8,800	+9,200	-
新型コロナ対応金融支援特別	-	-	▲3,000
当座預金増減	▲10,300	+16,300	+9,400
当座預金残高	4,933,100	4,949,400	4,958,800
準備預金残高	4,268,300	主な需給要因	
積み終了先	4,267,100		
超過準備	4,266,700		
非準備預金残高	664,800		
準備預金進捗率	99.8%		
平均	43.3%		
乖離率	56.5%		

11月28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
------	------	----	----	----	----	----

国債買入(固定利回り方式)(11/29~)

5~10年 0 0

5~10年 0 0

国債買入(11/29~)

3~5年 4,750 8,700 4,755 0.000 0.000 86.0

5~10年 5,500 12,604 5,507 ▲0.004 0.000 9.7

10~25年 2,500 5,537 2,513 0.009 0.011 36.8

25年~ 1,000 2,553 1,006 0.013 0.014 38.8

国債補充供給(11/28~11/29)

9,199 9,199 ▲0.350 ▲0.350

0 0

マネタリーベース [億円]

11月25日時点 6,200,100

所要

[億円]

今積期の所要準備額 3,767,900

11月29日以降の残り所要

積数 7,900

平均 500

国庫短期証券入札予定

12月2日	3ヶ月(第1124回)
12月8日	6ヶ月
12月9日	3ヶ月
12月16日	3ヶ月

国債入札予定

11月29日	2年
12月1日	10年
12月6日	30年
12月8日	5年

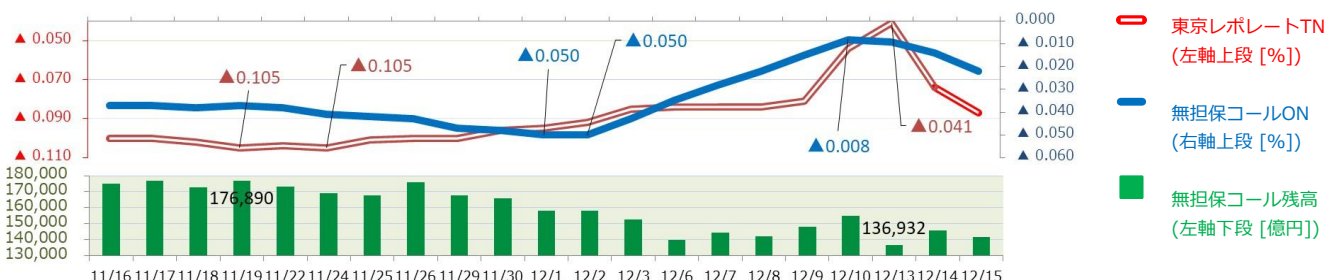
今月の国債買入オペ予定

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28日	0
5年超10年以下	5500	5,500	8 14 21 28	11月28日	0
10年超25年以下	2500	2,500	8 21 28	11月28日	0
25年超	1000	1,000	2 14 28	11月28日	0
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(登金)第243号 加入協会 日本証券業協会