



短期市場の推移

	11月22日	11月24日	11月25日	11月28日
加重平均金利	▲0.073	▲0.073	▲0.075	▲0.077
東京レボレート(TN)	▲0.099	▲0.101	▲0.102	▲0.131
無コール残	141,342	132,235	137,926	132,910
ON	73,435	64,303	70,594	65,698
その他	67,907	67,932	67,332	67,212
有コール残	31,588	31,663	31,756	30,403

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	▲0.078	▲0.107
T/N	-	-	-	▲0.121
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	▲0.075	▲0.122
2W	▲0.078	▲0.003	▲0.064	▲0.124
3W	-	-	-	▲0.128
1M	-	-	-	▲0.135
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.139
6M	-	-	-	▲0.131
1Y	-	-	-	▲0.128

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30日の予定 (時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
8:50	10月鉱工業生産指数[前月比]	▲1.7%	0:00	(米)11月消費者信頼感指数	100.0
	-	-	19:00	(欧)11月消費者物価コア指数[前年比]	-
	-	-	22:15	(米)11月ADP全米雇用報告	19.5万人

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▲0.078%の出合から始まり、その後は主に▲0.086%~▲0.075%の水準で取引された。引き続きビットサイドの調達意欲の減退がみられ、ON物加重平均金利(速報)は前営業日比▲0.001%の▲0.078%となり、2016年4月22日以来、約6年7ヶ月ぶりの低水準であった。

都銀・信託	証券	地銀
- ~ -	▲0.087 ~ ▲0.087	▲0.083 ~ ▲0.070

翌営業日のマーケット

一部の先で月末の調達を控える動きも想定され、出合いの水準は本日対比低下を予想する。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想
	11月29日	11月30日	11月30日	12月1日	12月1日
券	▲500	▲700	▲700	+1,000	+1,000
財政	▲5,600	+2,000	+2,000	▲22,000	▲22,000
過不足	▲6,100	+1,300	+1,300	▲21,000	▲21,000
金融調節	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド
国庫短期証券買入		+13,600		+1,000	+400
国債買入			▲2,500	+4,000	
CP等買入	▲400				
社債等買入	▲500				
国債補充供給	+9,200	▲9,200	+9,200		
新型コロナ対応金融支援特別			▲3,000	+2,800	
当座預金増減	+6,600	+13,200	+13,200	▲21,000	▲21,000
当座預金残高	4,939,700	4,952,900	4,952,900	4,931,900	4,931,900
準備預金残高	4,271,000	主な需給要因			
積み終了先	4,269,800	国債発行・償還(2年)			
超過準備	4,269,800				
非準備預金残高	668,700				
準備預金進捗率	99.8%				
平均	46.7%				
乖離率	53.2%				

11月29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(11/30~)	1,000	6,277	1,000	0.006	0.006	90.0
国債買入(固定利回り方式)(11/30~)						
5~10年		439	439			
5~10年		0	0			
米ドル資金供給(12/1~12/8)		0	0	4.090	4.090	
国債補充供給(11/29~11/30)		9,129	9,129	▲0.350	▲0.350	
		0	0			

マナタリーベース (億円)
11月28日時点 6,190,000

所要	(億円)
今積期の所要準備額	3,767,900
11月30日以降の残り所要	
積数	6,700
平均	400

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

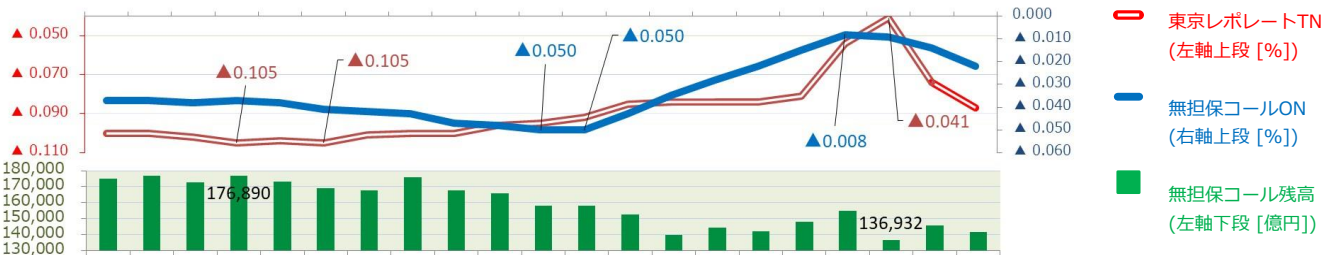
今月の国債買入オペ予定

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 近畿財務局長(登金)第243号 加入協会 日本証券業協会