



短期市場の推移

	11月24日	11月25日	11月28日	11月29日
加重平均金利	▲0.073	▲0.075	▲0.077	▲0.078
東京レボレート(TN)	▲0.101	▲0.102	▲0.131	▲0.121
無コール残	132,235	137,926	132,910	129,595
ON	64,303	70,594	65,698	62,393
その他	67,932	67,332	67,212	67,202
有コール残	31,663	31,756	30,403	29,350

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	▲0.079	▲0.115
T/N	-	-	-	▲0.128
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	▲0.075	▲0.126
2W	▲0.078	▲0.035	▲0.058	▲0.127
3W	-	-	-	▲0.131
1M	-	-	▲0.075	▲0.148
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.140
6M	-	-	-	▲0.131
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

12月1日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	(米)10月個人消費支出(PCE)価格コア指数[前年比]	5.0%
-	-	(米)新規失業保険申請件数[前週分]	-
-	-	-	-

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▲0.080%の合出から始まり、その後は主に▲0.087%~▲0.078%の水準で取引された。月末のため調達を控える先が散見され、ON物加重平均金利(速報)は前営業日比▲0.001%の▲0.079%となった。

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

翌営業日のマーケット

前営業日に月末要因により調達を控えていた先が調達を再開するため、出合いの水準は本日対比で上昇すると予想する。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	11月30日	12月1日	12月1日	12月2日	12月2日	12月2日
券	▲700	▲1,100	▲1,100	+1,000	+1,000	+1,000
財政	▲1,400	▲53,900	▲53,900	▲82,000	▲82,000	▲82,000
過不足	▲2,100	▲55,000	▲55,000	▲81,000	▲81,000	▲81,000
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		+400		+1,400		
CP等買入	▲2,500	+4,000	▲100			
国債補充供給	+9,200	▲8,400	+8,400			
成長基盤強化支援					▲4,100	
新型コロナ対応金融支援特別	▲3,000	+2,800				
当座預金増減		+1,400	▲45,300	▲85,100	▲85,100	▲85,100
当座預金残高	4,941,100		4,895,800		4,810,700	
準備預金残高	4,292,300					
積み終了先	4,291,000		国債発行・償還		主な需給要因	
超過準備	4,291,000		(2年)		(10年)	
非準備先残高	648,800					
準備預金進捗率		99.9%				
平均		50.0%				
乖離率		49.9%				

11月30日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
国債買入(固定利回り方式)(12/1~)						
5~10年	1,365	1,365				
5~10年	0	0				
5~10年	0	0				
国債補充供給(11/30~12/1)						
	8,356	8,356	▲0.350	▲0.350		
	51	51	▲0.350	▲0.350		

マネタリーベース (億円)
11月29日時点 6,197,100

所要	(億円)
今積期の所要準備額	3,767,900
12月1日以降の残り所要	
積数	5,500
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

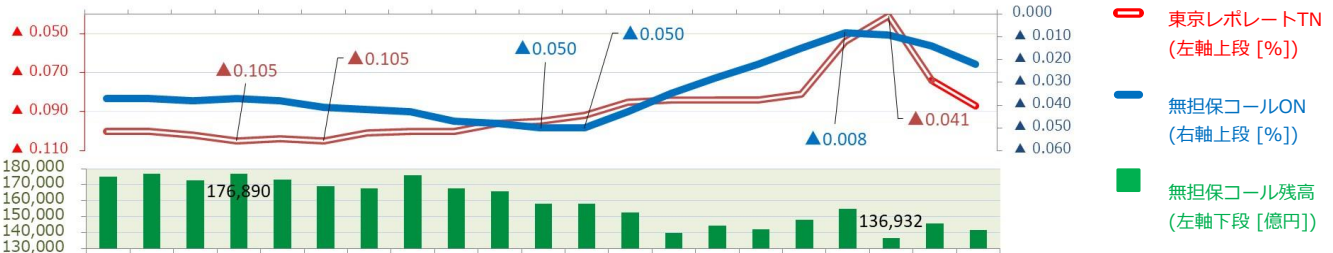
来月の国債買入オペ予定

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	1500	1,500	月1回	11月2日	1
1年超3年以下	4750	4,750	2 7 14 19	11月21日	4
3年超5年以下	4750	4,750	2 14 19 26	11月28日	4
5年超10年以下	5500	5,500	7 14 19 26	11月28日	4
10年超25年以下	2500	2,500	7 19 26	11月28日	3
25年超	1000	1,000	2 14 26	11月28日	3
物価連動債	600	600	月1回	11月14日	1
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