



### 短期市場の推移

	11月14日	11月15日	11月16日	11月17日
加重平均金利	▲0.012	▲0.011	▲0.027	▲0.015
東京レボレート(TN)	▲0.140	▲0.154	▲0.130	▲0.118
無コール残	167,414	161,353	153,534	158,846
ON	93,731	91,030	86,651	90,343
その他	73,683	70,323	66,883	68,503
有コール残	25,986	27,035	27,468	23,823

[億円] [%]

### 11月21日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
8:30	9月の毎月勤労統計(確報)	(米) FOMC議事録 (10月31日~11月1日)	
	-	-	-
	-	-	-

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	▲0.013	▲0.096
T/N	-	-	-	▲0.111
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.040	▲0.008	▲0.033	▲0.146
2W	▲0.030	0.001	▲0.021	▲0.161
3W	-	-	0.005	▲0.170
1M	-	-	▲0.020	▲0.183
2M	-	-	-	-
3M	-	-	0.025	▲0.195
6M	-	-	-	▲0.120
1Y	-	-	-	▲0.080

### 本日の市況

無担保コールON物は▲0.01%の合出から始まり、その後は主に▲0.018%~▲0.008%を中心に取引された。引き続きビットサイドの調達意欲が強く、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.002%上昇の▲0.013%となった。

都銀・信託	証券	地銀
- ~ -	- ~ -	▲0.018 ~ ▲0.008

### 翌営業日のマーケット

引き続きビットサイドの調達意欲は旺盛であり、合出の水準は本日対比横這い圏を予想する。

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

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	11月20日	11月21日	11月21日	11月22日	11月22日	11月22日
券		▲200	▲300	▲1,000		
財政		▲6,300	▲2,400	▲14,000		
過不足		▲6,500	▲2,700	▲15,000		
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
共通担保(全店)					▲6,600	
CP等買入	▲300		▲100			
社債等買入	▲500			+1,000		
国債補充供給	+36,800	▲37,300	+37,300			
当座預金増減		▲7,800	+35,500	▲21,600		
当座預金残高		5,443,600	5,479,100	5,457,500		
準備預金残高		4,746,900				
積み終了先		4,741,800				
超過準備		4,739,300				
非準備先残高		696,700				
準備預金進捗率		99.0%				
平均		16.7%				
乖離率		82.4%				

### 11月20日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
国債補充供給(11/20~11/21)	37,716	37,716	▲0.350	▲0.351		
	150	150	▲0.350	▲0.350		

マナタリーベース [億円]  
11月17日時点 6,705,400

所要	[億円]
今積期の所要準備額	3,891,200
11月21日以降の残り所要	
積数	37,100
平均	1,500

### 国庫短期証券入札予定

11月24日	3ヶ月(第1197回)
12月1日	3ヶ月
12月7日	6ヶ月
12月8日	3ヶ月
11月21日	20年
11月28日	40年
11月30日	2年
12月5日	10年

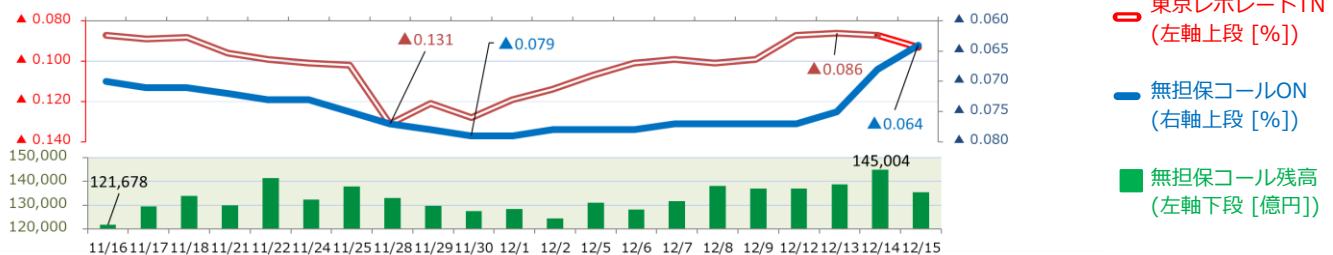
### 今月の国債買入オペ予定

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10日	0
1年超3年以下	3,500~6,500	3,750	6 10 15 22	11月15日	1
3年超5年以下	4,000~7,500	4,500	6 10 22 29	11月10日	2
5年超10年以下	4,500~9,000	5,750	6 15 22 29	11月15日	2
10年超25年以下	1,000~5,000	2,000	6 10 15 29	11月15日	1
25年超	500~3,500	1,000	6 15 22	11月15日	1
物価連動債	600	600	月1回	10月27日	1
変動利付債	-	300	-	4月14日	-

### 1年前の市場推移

○2022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