



短期市場の推移

	11月15日	11月16日	11月17日	11月20日
加重平均金利	▲0.011	▲0.027	▲0.015	▲0.013
東京レポレート(TN)	▲0.154	▲0.130	▲0.118	▲0.111
無コール残	161,353	153,534	158,846	164,478
ON	91,030	86,651	90,343	93,915
その他	70,323	66,883	68,503	70,563
有コール残	27,035	27,468	23,823	27,247

加重平均金利・コール残高は日銀、東京レポ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)			レポ市場	
	最低	最高	平均	東京レポレート	
O/N	▲0.080	0.001	▲0.012	▲0.094	
T/N	-	-	-	▲0.107	
S/N	-	-	-	-	
1W	▲0.015	▲0.008	▲0.013	▲0.144	
2W	▲0.020	▲0.015	▲0.019	▲0.162	
3W	-	-	-	▲0.169	
1M	-	-	0.011	▲0.183	
2M	-	-	-	-	
3M	0.025	0.150	0.027	▲0.194	
6M	-	-	-	▲0.120	
1Y	-	-	-	▲0.080	

無担保コール(速報)は日銀、東京レポレートは日本証券業協会公表

11月22日の予定 (時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
	-		-	
	-		-	
	-		-	

本日の市況

無担保コールON物は▲0.01%の出合から始まり、その後は主に▲0.015%~▲0.007%を中心に取引された。引き続きビッド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+0.001%上昇の▲0.012%となった。

	都銀・信託	証券	地銀
	- ~ -	- ~ -	▲0.015 ~ ▲0.007

翌営業日のマーケット

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

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	11月21日	11月22日	11月22日	11月24日	11月24日	11月24日
券	▲400		▲1,400		▲1,000	
財政	▲3,300		▲12,000		▲1,000	
過不足	▲3,700		▲13,400		▲2,000	
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		
共通担保(全店)			▲6,600	+6,400		
CP等買入	▲100		▲300			
社債等買入		+1,000	▲100			
国債補充供給	+37,300	▲38,200	+38,200			
当座預金増減	▲3,700		+25,200		▲2,000	
当座預金残高	5,439,900		5,465,100		5,463,100	
準備預金残高	4,737,200					
積み終了先	4,732,300					
超過準備	4,732,100					
非準備先残高	702,700					
準備預金進捗率	99.2%					
平均	20.0%					
乖離率	79.2%					

11月21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(11/22~)	1,000	6,157	1,000	0.012	0.013	90.0
米ドル資金供給(11/24~11/30)	2	2	5,580	5,580		
国債補充供給(11/21~11/22)	38,615	38,615	▲0.350	▲0.351		
共通担保(全店)(11/22~12/6)	16	16	▲0.350	▲0.350		
米ドル資金供給用担保国債供給(11/22~12/1)	5,000	2	2	▲0.100	▲0.100	

マネタリーベース [億円]
11月20日時点 6,697,700

所要	今積期の所要準備額	11月22日以降の残り所要
積数	3,891,200	32,000
平均		1,300

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

国債入札予定

11月28日	40年
11月30日	2年
12月5日	10年
12月7日	30年

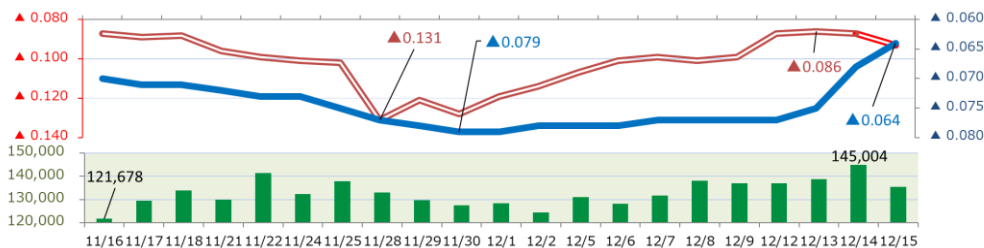
今月の国債買入オペ予定

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。



東京レポレート TN (左軸上段 [%])
 無担保コールON (右軸上段 [%])
 無担保コール残高

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