



短期市場の推移

	11月17日	11月20日	11月21日	11月22日
加重平均金利	▲0.015	▲0.013	▲0.012	▲0.012
東京レボレート(TN)	▲0.118	▲0.111	▲0.107	▲0.106
無コール残	158,846	164,478	159,436	174,414
ON	90,343	93,915	86,583	100,371
その他	68,503	70,563	72,853	74,043
有コール残	23,823	27,247	25,563	26,317

[億円] [%]

11月27日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	-	-
-	-	-	-
-	-	-	-

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	▲0.080	0.000	▲0.012	▲0.085
T/N	-	-	-	▲0.099
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.040	▲0.008	▲0.029	▲0.132
2W	▲0.020	▲0.012	▲0.012	▲0.147
3W	-	-	-	▲0.159
1M	▲0.003	0.015	0.011	▲0.172
2M	-	-	-	-
3M	-	-	0.025	▲0.194
6M	-	-	-	▲0.120
1Y	-	-	-	▲0.080

本日の市況

無担保コールON物は▲0.009%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。週間3日積みとなった本日は、ビッドサイドの調達意欲が底堅く、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比横ばいの▲0.012%となった。

都銀・信託	証券	地銀
- ~ -	▲0.010 ~ ▲0.010	▲0.018 ~ ▲0.008

翌営業日のマーケット

オファー・ビッドの動向に大きな変化はなく、出合の水準は本日対比横ばい圏を予想する。

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24日	11月27日	11月27日	11月28日	11月28日	11月28日
券	+200	▲300	▲300	+0	+0	+0
財政	+5,500	▲3,700	▲3,700	▲2,000	▲2,000	▲2,000
過不足	+5,700	▲4,000	▲4,000	▲2,000	▲2,000	▲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
国債買入		+14,100				
CP等買入	▲400		▲400			
社債等買入	▲300		▲800			
国債補充供給	+38,900	▲42,700	+42,700			
当座預金増減	+15,300	+37,500	+37,500	▲2,000	▲2,000	▲2,000
当座預金残高	5,442,400	5,479,900	5,479,900	5,477,900	5,477,900	5,477,900
準備預金残高	4,748,400			主な需給要因		
積み終了先	4,746,200	国庫短期証券発行・償還(3M)				
超過準備	4,746,200					
非準備先残高	694,000					
準備預金進捗率	99.5%					
平均	36.7%					
乖離率	62.9%					

11月24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
国債補充供給(11/24~11/27)	43,317	43,317	▲0.350	▲0.351		
	0	0				

マナタリーベース [億円]
11月22日時点 6,682,900

所要	[億円]
今積期の所要準備額	3,891,200
11月27日以降の残り所要	
積数	18,200
平均	1,000

国庫短期証券入札予定

入札日	3ヶ月(第1198回)
12月1日	6ヶ月
12月7日	3ヶ月
12月8日	3ヶ月
12月15日	3ヶ月

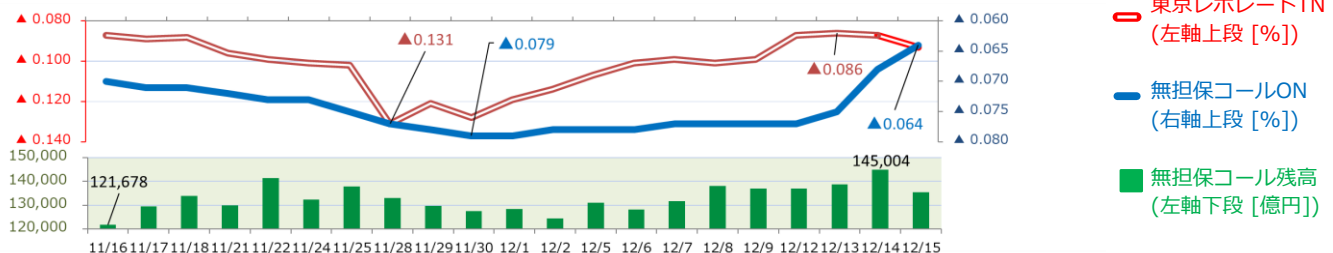
今月の国債買入オペ予定

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10日	0
1年超3年以下	3,500~6,500	3,750	6 10 15 22	11月22日	0
3年超5年以下	4,000~7,500	4,500	6 10 22 29	11月22日	1
5年超10年以下	4,500~9,000	5,250	6 15 22 29	11月22日	1
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	750	6 15 22	11月22日	0
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