



短期市場の推移

	11月20日	11月21日	11月22日	11月24日
加重平均金利	▲0.013	▲0.012	▲0.012	▲0.012
東京レボレート(TN)	▲0.111	▲0.107	▲0.106	▲0.099
無コール残	164,478	159,436	174,414	165,727
ON	93,915	86,583	100,371	92,925
その他	70,563	72,853	74,043	72,802
有コール残	27,247	25,563	26,317	26,713

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	▲0.017	▲0.077
T/N	-	-	-	▲0.097
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.040	▲0.020	▲0.033	▲0.131
2W	-	-	▲0.003	▲0.142
3W	-	-	-	▲0.157
1M	-	-	-	▲0.172
2M	-	-	-	-
3M	-	-	0.020	▲0.192
6M	-	-	-	▲0.116
1Y	-	-	-	▲0.078

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28日の予定 (時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
14:00	基調的なインフレ率を捕捉するための指標 (10月)			
	-	-	-	-
	-	-	-	-

本日の市況

無担保コールON物は▲0.015%の出合から始まり、その後は主に▲0.020%~▲0.010%を中心に取引された。週末3日積みの調達要因が剥落し、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.005%の▲0.017%となった。

	都銀・信託	証券	地銀
	- ~ -	- ~ -	▲0.020 ~ ▲0.010

翌営業日のマーケット

ビッドサイドの調達意欲は減退方向であり、出合の水準は本日対比低下すると予想。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	11月27日	11月28日	11月28日	11月29日	11月29日	11月29日
券		▲200	▲500			+0
財政		▲4,500	▲4,100			▲14,000
過不足		▲4,700	▲4,600			▲14,000
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
CP等買入	▲400		▲400			
社債等買入	▲800					
国債補充供給	+42,700	▲41,800	+41,800			
当座預金増減		▲5,000	+36,800			▲14,000
当座預金残高		5,437,400	5,474,200			5,460,200
準備預金残高		4,757,500				主な需給要因
積み終了先		4,755,100				国債発行(40年)
超過準備		4,755,100				
非準備先残高		679,900				
準備預金進捗率		99.6%				
平均		40.0%				
乖離率		59.6%				

11月27日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
CP等買入(11/30~)	4,000	7,186	3,986	0.000	0.027	50.1
国債補充供給(11/27~11/28)	42,507	42,507	▲0.350	▲0.351		
	0	0				

マネタリーベース (億円)
 11月24日時点 6,698,100

所要	(億円)
今積期の所要準備額	3,891,200
11月28日以降の残り所要	
積数	15,800
平均	900

国庫短期証券入札予定

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

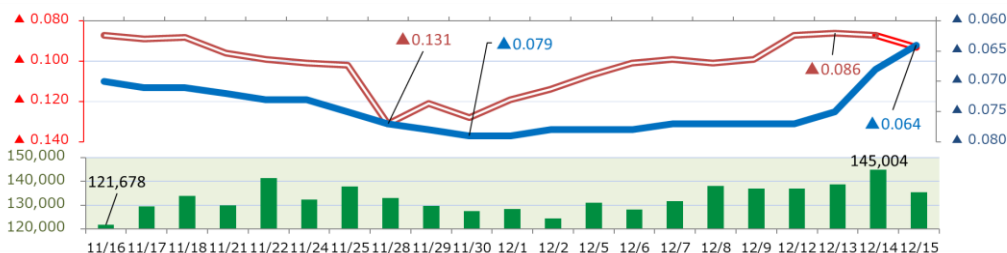
今月の国債買入オペ予定

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。



- 東京レボレートTN (左軸上段 [%])
- 無担保コールON (右軸上段 [%])
- 無担保コール残高 (左軸下段 [億円])

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