



短期市場の推移

	11月21日	11月22日	11月24日	11月27日
加重平均金利	▲0.012	▲0.012	▲0.012	▲0.017
東京レボレート(TN)	▲0.107	▲0.106	▲0.099	▲0.097
無コール残	159,436	174,414	165,727	168,196
ON	86,583	100,371	92,925	94,679
その他	72,853	74,043	72,802	73,517
有コール残	25,563	26,317	26,713	27,230

[億円] [%]

11月29日の予定 (時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
8:50	貿易収支 (11月上旬)		22:30	(米) GDP (2次速報)	+5.0%
	-			(米) ページブック	
	-			-	

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、無担保コール残高は無担保・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	▲0.021	▲0.087
T/N	-	-	-	▲0.100
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.030	▲0.025	▲0.026	▲0.132
2W	▲0.033	0.003	▲0.026	▲0.143
3W	-	-	-	▲0.156
1M	-	-	0.005	▲0.167
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.195
6M	-	-	-	▲0.116
1Y	-	-	-	▲0.076

本日の市況

無担保コールON物は▲0.018%の合出から始まり、その後は主に▲0.025%~▲0.010%を中心に取引された。ビッドサイドの調達意欲の低下がみられ、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.004%の▲0.021%となった。

都銀・信託	証券	地銀
- ~ -	- ~ -	▲0.025 ~ ▲0.010

翌営業日のマーケット

ビッドサイドの慎重姿勢に変化はなく、出合い水準は本日対比横ばい圏で推移を想定。

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28日	11月29日	11月29日	11月30日	11月30日
券		▲500	▲600	▲100	
財政		▲4,500	▲10,900	▲1,100	
過不足		▲5,000	▲11,500	▲1,200	
金融調節	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド
国庫短期証券買入			+1,000		
CP等買入	▲400		▲400		+4,000
国債補完供給	+41,800	▲41,300	+41,300		
当座預金増減		▲4,900	+30,400	+2,800	
当座預金残高		5,432,500	5,462,900	5,465,700	
準備預金残高		4,744,900	主な需給要因		
積み終了先		4,742,400	国債発行 (40年)		
超過準備		4,742,400			
非準備預金先高		687,600			
準備預金進捗率		99.7%			
平均		43.3%			
乖離率		56.3%			

11月28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(11/29~)	1,000	8,733	1,000	0.021	0.021	
米ドル資金供給(11/30~12/7)	0	0	5.580			
国債補完供給(11/28~11/29)	41,989	41,989	▲0.350	▲0.351		
	0	0				

マネタリーベース (億円)
11月27日時点 6,693,400

所要	所要
今積期の所要準備額	3,891,200
11月29日以降の残り所要	
積数	13,300
平均	800

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

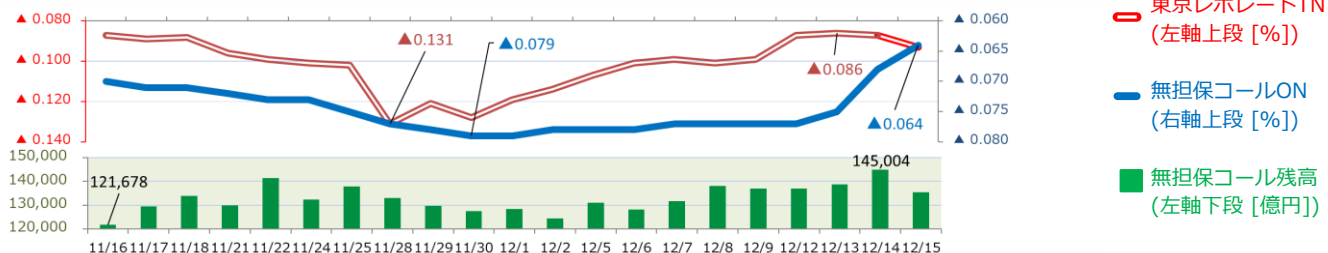
今月の国債買入オペ予定

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。



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