



短期市場の推移

	11月24日	11月27日	11月28日	11月29日
加重平均金利	▲0.012	▲0.017	▲0.021	▲0.022
東京レポレート(TN)	▲0.099	▲0.097	▲0.100	▲0.108
無コール残	165,727	168,196	176,111	176,761
ON	92,925	94,679	101,874	101,784
その他	72,802	73,517	74,237	74,977
有コール残	26,713	27,230	28,604	27,110

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)			レポ市場
	最低	最高	平均	東京レポレート
O/N	▲0.087	0.001	▲0.022	▲0.091
T/N	-	-	-	▲0.101
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.019	▲0.013	▲0.017	▲0.127
2W	▲0.035	0.010	▲0.030	▲0.136
3W	-	-	-	▲0.152
1M	▲0.028	▲0.023	▲0.026	▲0.178
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.189
6M	-	-	-	▲0.114
1Y	-	-	-	▲0.076

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

12月1日の予定 (時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
8:30	10月有効求人倍率	1.29倍	0:00	11月ISM製造業指数
13:00	日銀当座預金増減要因と金融調節 (11月実績)			11月製造業PMI (確報)
16:00	債券市場サーベイ (23年11月調査)			パウエルFRB議長対談

本日の市況

無担保コールON物は▲0.018%の出会いから始まり、その後は主に▲0.025%~▲0.018%を中心に取引された。市場参加者の動向に大きな変化はなく、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比横ばいの▲0.022%となった。

都銀・信託	証券	地銀
- ~ -	- ~ -	▲0.025 ~ ▲0.018

翌営業日のマーケット

週末3日積みのため、出会い水準は本日対比横ばいから若干の上昇を想定。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想
	11月30日	12月1日	12月1日	12月4日	12月4日
券	▲800	▲600	▲600	▲1,000	▲1,000
財政	+6,400	▲48,100	▲48,100	▲110,000	▲110,000
過不足	+5,600	▲48,700	▲48,700	▲111,000	▲111,000
金融調節	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド
国債買入		+12,400			
CP等買入	▲3,600	+4,000			
社債等買入			▲200		
国債補完供給	+40,500	▲39,900	+39,900		
成長基盤強化支援					▲10,300
当座預金増減	+19,000	▲9,000	▲9,000	▲121,300	▲121,300
当座預金残高	5,440,600	5,431,600	5,431,600	5,310,300	5,310,300
準備預金残高	4,722,300				
積み終了先	4,720,200				
超過準備	4,720,200				
非準備先残高	718,300				
準備預金進捗率	99.8%				
平均	50.0%				
乖離率	49.8%				

11月30日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
国債補完供給(11/30~12/1)	40,191	40,191	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マネタリーベース (億円) 11月29日時点 6,678,700

所要	(億円)
今積期の所要準備額	3,891,200
12月1日以降の残り所要	
積数	9,000
平均	600

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(第1199回)
12月8日	3ヶ月
12月15日	3ヶ月

国債入札予定

12月5日	10年
12月7日	30年
12月12日	5年
12月14日	20年

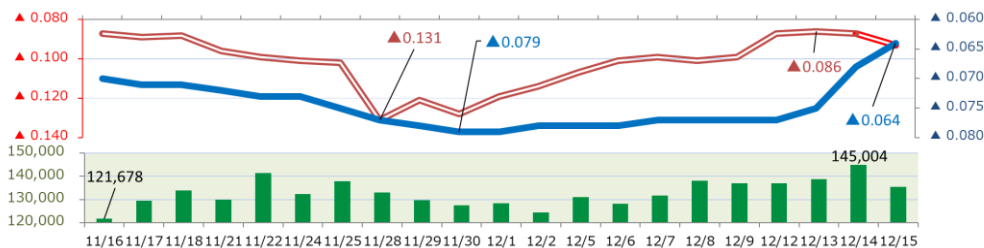
来月の国債買入オペ予定

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	1
1年超3年以下	3,500~6,500	3,750	4 8 13 18	11月22日	4
3年超5年以下	4,000~7,500	4,500	4 8 18 25	11月29日	4
5年超10年以下	4,500~9,000	5,250	8 13 18 25	11月29日	4
10年超25年以下	1,000~5,000	2,000	4 8 18 25	11月29日	4
25年超	500~3,500	750	4 13 25	11月22日	3
物価連動債	600	600	月1回	11月29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