



デイリーシグナル

2021年11月17日(水)

短期市場の推移

	11月11日	11月12日	11月15日	11月16日
加重平均金利	▲0.047	▲0.038	▲0.030	▲0.037
東京レポレート(TN)	▲0.085	▲0.085	▲0.100	▲0.100
無コール残	141,261	146,944	135,176	174,838
ON	67,083	72,866	63,898	97,320
その他	74,178	74,078	71,278	77,518
有コール残	19,198	18,308	18,634	17,614

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	▲0.086	0.001	▲0.037	▲0.094
T/N	-	-	▲0.040	▲0.100
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.005	0.050	0.005	▲0.100
2W	▲0.022	▲0.020	▲0.021	▲0.101
3W	-	-	-	▲0.103
1M	▲0.005	▲0.001	▲0.004	▲0.105
2M	-	-	0.015	-
3M	-	-	-	▲0.114
6M	-	-	-	▲0.122
1Y	-	-	-	▲0.131

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18日の予定 (時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
	-			-	
	-			-	
	-			-	

経済指標及び予想値は株式会社フィスコ提供

本日の市況

本日の無担保コールON物は▲0.025%の出会いから始まり、その後は主に▲0.060%~▲0.008%の水準で出会いが見られた。調達サイドの動向に大きな変化はなく、本日の同加重平均金利(速報)は前営業日対比横ばいの▲0.037%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.080 ~ ▲0.080	▲0.040 ~ ▲0.040	▲0.060 ~ ▲0.001

翌営業日のマーケット

放出サイド・調達サイドともに大きなニーズの変化はなく、出合水準は本日対比横ばいを予想。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	11月17日	11月18日	11月18日	11月19日	11月19日	11月19日
券	▲200		▲1,100		▲1,000	
財政	▲30,400		+1,800		▲9,000	
過不足	▲30,600		+700		▲10,000	
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				
国債買入			+9,300			
共通担保(全店)		+100	▲100			
CP等買入	▲200		▲200			
国債補充供給	+300	▲500	+500			
当座預金増減	▲29,900		+10,200		▲10,000	
当座預金残高	5,356,900		5,367,100		5,357,100	
準備預金残高	4,715,300		主な需給要因			
積み終了先	4,699,600		国債発行(20年)			
超過準備	4,393,400					
非準備先残高	641,600					
準備預金進捗率	99.7%					
平均	6.7%					
乖離率	93.0%					

11月17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
国債買入(11/18~)						
1~3年	4,500	13,623	4,504	▲0.002	▲0.002	96.2
5~10年	4,250	7,816	4,256	0.001	0.002	36.4
25年~	500	2,091	504	0.012	0.013	34.9
国債補充供給(11/17~11/18)						
	411	411	▲0.350	▲0.350		
	0	0				
共通担保(全店)(11/17~11/18)						
	1,000	55	55			

マネタリーベース (億円)
11月16日時点 6,607,700

所要	今積期の所要準備額	11月18日以降の残り所要
	3,633,000	
積数	11,700	
平均	400	

国庫短期証券入札予定

11月18日	1年(第1038回)
11月19日	3ヶ月(第1039回)
11月24日	6ヶ月(第1040回)
11月26日	3ヶ月

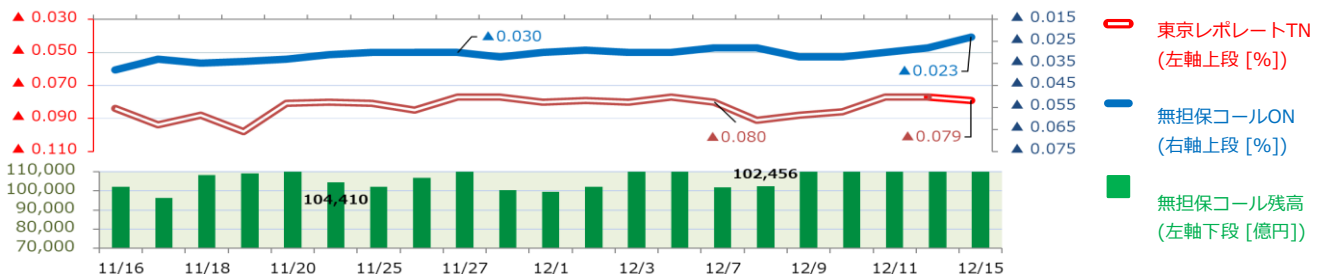
今月の国債買入オペ予定

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	10月8日	1
1年超3年以下	4500	4,500	2 10 17 24	11月17日	1
3年超5年以下	4500	4,500	2 10 24 29	11月10日	2
5年超10年以下	4250	4,250	10 17 24 29	11月17日	2
10年超25年以下	1500	1,500	2	11月2日	0
25年超	500	500	17	11月17日	0
物価連動債	600	600	月1回	10月26日	1
変動利付債<四半期>	300	300	四半期に1回	10月13日	-

1年前の市場推移

○2020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