



デイリーシグナル

2021年11月19日(金)

短期市場の推移

	11月15日	11月16日	11月17日	11月18日
加重平均金利	▲0.030	▲0.037	▲0.037	▲0.038
東京レボレート(TN)	▲0.100	▲0.100	▲0.100	▲0.102
無コール残	135,176	174,838	176,711	172,653
ON	63,898	97,320	95,743	91,415
その他	71,278	77,518	80,968	81,238
有コール残	18,634	17,614	18,226	17,154

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	▲0.086	0.001	▲0.037	▲0.098
T/N	-	-	▲0.040	▲0.105
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	▲0.003	▲0.104
2W	-	-	▲0.025	▲0.104
3W	-	-	0.180	▲0.104
1M	-	-	▲0.030	▲0.106
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.116
6M	-	-	-	▲0.123
1Y	-	-	-	▲0.130

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22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▲0.040%の出合いから始まり、その後は主に▲0.040%~▲0.015%の水準で出合いが見られた。放出サイド、調達サイド動向は昨日と特段の変化なく、本日の同加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.001%の▲0.037%となった。

都銀・信託	証券	地銀
- ~ -	▲0.040 ~ ▲0.040	▲0.040 ~ ▲0.015

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19日	11月22日	11月22日	11月24日	11月24日
券		▲500		▲800	+0
財政		▲6,200		▲7,500	+2,000
過不足		▲6,700		▲8,300	+2,000
金融調節	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド
共通担保(全店)					▲2,500
CP等買入	▲1,000		▲600		
社債等買入					+800
国債補充供給	+100				
新型コロナ対応金融支援特別	▲100				
当座預金増減		▲7,700		▲8,900	+300
当座預金残高		5,359,400		5,350,500	5,350,800
準備預金残高		4,709,200	主な需給要因		
積み終了先		4,708,700	国債償還(15年)		
超過準備		4,708,400	国庫短期証券発行・償還(3M、1Y)		
非準備先残高		650,200			
準備預金進捗率		99.9%			
平均		20.0%			
乖離率		79.9%			

11月19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(11/19~11/22)	39	39	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マネタリーベース [億円]
11月18日時点 6,589,300

所要	[億円]
今積期の所要準備額	3,633,000
11月22日以降の残り所要	
積数	4,200
平均	200

国庫短期証券入札予定

11月24日	6ヶ月(第1040回)
11月26日	3ヶ月(第1041回)
9月3日	3ヶ月
9月9日	6ヶ月
11月25日	40年
11月30日	2年
9月2日	10年
9月7日	30年

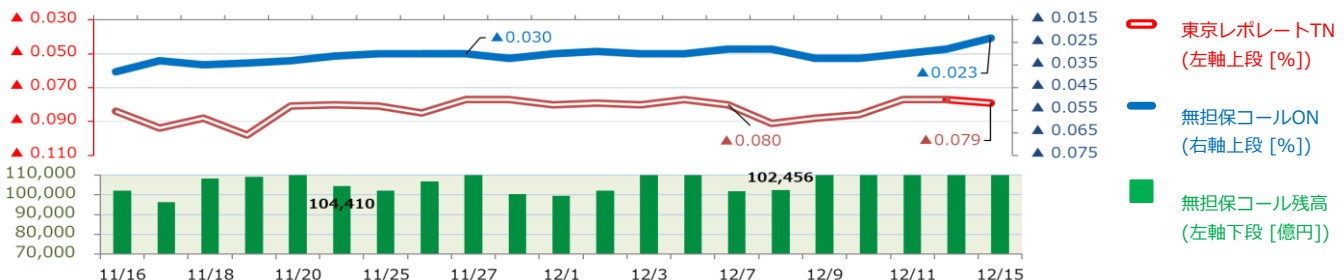
今月の国債買入オペ予定

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