



## デイリーシグナル

2021年11月22日(月)

### 短期市場の推移

	11月16日	11月17日	11月18日	11月19日
加重平均金利	▲0.037	▲0.037	▲0.038	▲0.037
東京レポレート(TN)	▲0.100	▲0.100	▲0.102	▲0.105
無コール残	174,838	176,711	172,653	176,890
ON	97,320	95,743	91,415	97,617
その他	77,518	80,968	81,238	79,273
有コール残	17,614	18,226	17,154	17,211

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	▲0.085	0.001	▲0.038	▲0.102
T/N	-	-	▲0.045	▲0.104
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.025	▲0.010	▲0.023	▲0.104
2W	▲0.020	▲0.010	▲0.016	▲0.105
3W	-	-	▲0.005	▲0.105
1M	-	-	-	▲0.107
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.115
6M	-	-	-	▲0.123
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24日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	22:30 (米)新規失業保険申請件数 [前週分]	-
-	-	22:30 (米)7-9月期国内総生産 (GDP) 改定値[前期比年率]	2.2%
-	-	-	-

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%の出会いから始まり、その後は主に▲0.060%~▲0.020%の水準で出会いが見られた。放出サイド、調達サイド動向に変化は見られず、引き続き横ばいの水準での取引となった。本日の同加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.001%の▲0.038%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.078 ~ ▲0.078	- ~ -	▲0.060 ~ ▲0.020

### 翌営業日のマーケット

大きな地合の変化はなく、出会い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22日	11月24日	11月24日	11月25日	11月25日	11月25日
券	▲800	▲400	▲400	+0		
財政	▲8,300	▲5,400	▲5,400	▲4,000		
過不足	▲9,100	▲5,800	▲5,800	▲4,000		
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
共通担保(全店)			▲2,500	+2,600		
CP等買入	▲600		▲300			
社債等買入			▲100	+800		
当座預金増減	▲9,700	▲5,300	▲5,300	▲4,000		
当座預金残高	5,349,700	5,344,400	5,344,400	5,340,400		
準備預金残高	4,706,600					
積み終了先	4,706,200					
超過準備	4,706,100					
非準備先残高	643,100					
準備預金進捗率	99.9%					
平均	26.7%					
乖離率	73.2%					

### 11月22日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
米ドル資金供給(11/26~12/2)	0	0	0.330	0.330		
国債補充供給(11/22~11/24)	38	38	▲0.350	▲0.350		
共通担保(全店)(11/24~12/8)	20,000	2,601	2,601			

マナリーベース	所要
11月19日時点 6,582,200	今積期の所要準備額 3,633,000
	11月24日以降の残り所要
	積数 3,200
	平均 100

### 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

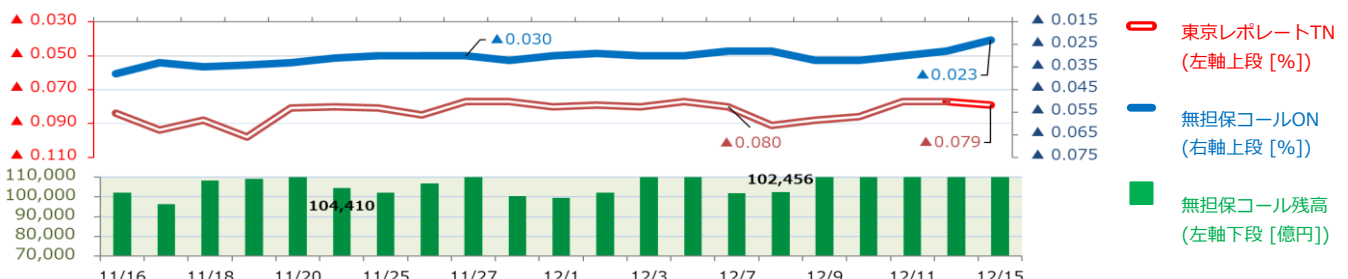
### 今月の国債買入オペ予定

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 17	11月2日	0
25年超	500	500		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