



デイリーシグナル

2021年11月26日(金)

短期市場の推移

	11月19日	11月22日	11月24日	11月25日
加重平均金利	▲0.037	▲0.038	▲0.041	▲0.042
東京レボレート(TN)	▲0.105	▲0.104	▲0.105	▲0.101
無コール残	176,890	173,297	169,169	167,592
ON	97,617	92,974	89,416	86,489
その他	79,273	80,323	79,753	81,103
有コール残	17,211	17,281	17,605	17,273

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	▲0.085	0.001	▲0.043	▲0.098
T/N	-	-	▲0.055	▲0.100
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	-	▲0.103
2W	-	-	▲0.008	▲0.104
3W	-	-	▲0.002	▲0.105
1M	▲0.010	▲0.005	▲0.007	▲0.108
2M	-	-	0.015	-
3M	-	-	-	▲0.116
6M	-	-	-	▲0.124
1Y	-	-	-	▲0.132

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29日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	NY連銀総裁の講演	-
-	-	-	-
-	-	-	-

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▲0.030%の出会いから始まり、その後は主に▲0.050%~▲0.010%の水準で出会いが見られた。週末3日積みであったが、大きな動向の変化はなく、本日の同加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.001%の▲0.043%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.085 ~ ▲0.085	▲0.055 ~ ▲0.055	▲0.050 ~ ▲0.020

翌営業日のマーケット

大きな地合いの変化はないと思われ、出会い水準は本日対比横ばい圏を予想。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	11月26日	11月29日	11月29日	11月30日	11月30日	11月30日
券	▲800	▲700	▲700	▲300	▲300	▲300
財政	▲7,800	+4,800	+4,800	+3,000	+3,000	+3,000
過不足	▲8,600	+4,100	+4,100	+2,700	+2,700	+2,700
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
CP等買入	▲200		▲400			+5,000
社債等買入	▲100					
国債補完供給	+100	▲100	+100			
新型コロナ対応金融支援特別	▲55,300	+69,200				
当座預金増減	+5,000	+3,800	+3,800	+7,700	+7,700	+7,700
当座預金残高	5,359,400	5,363,200	5,363,200	5,370,900	5,370,900	5,370,900
準備預金残高	4,710,500	4,710,200	4,710,200	4,710,200	4,710,200	4,710,200
積み終了先	4,710,200	4,710,200	4,710,200	4,710,200	4,710,200	4,710,200
超過準備	4,710,100	4,710,100	4,710,100	4,710,100	4,710,100	4,710,100
非準備先残高	648,900	648,900	648,900	648,900	648,900	648,900
準備預金進捗率	99.9%	99.9%	99.9%	99.9%	99.9%	99.9%
平均	43.3%	43.3%	43.3%	43.3%	43.3%	43.3%
乖離率	56.6%	56.6%	56.6%	56.6%	56.6%	56.6%

11月26日のオペ結果

11月26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
国債補完供給(11/26~11/29)	53	53	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マナリーベース [億円]
11月25日時点 6,579,900

所要	[億円]
今積期の所要準備額	3,633,000
11月29日以降の残り所要	
積数	1,400
平均	100

国庫短期証券入札予定

12月3日	3ヶ月
12月9日	6ヶ月
12月10日	3ヶ月
12月14日	6ヶ月
11月30日	2年
12月2日	10年
12月7日	30年
12月9日	5年

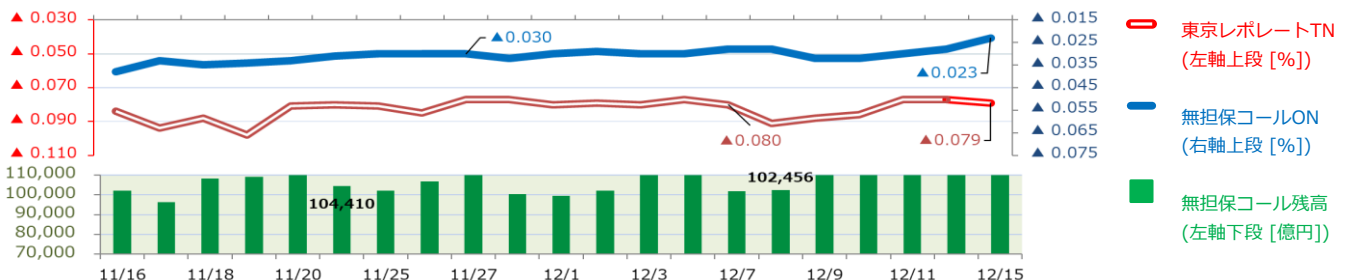
今月の国債買入オペ予定

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	11月24日	0
1年超3年以下	4500	4,500	2 10 17 24	11月24日	0
3年超5年以下	4500	4,500	2 10 24 29	11月24日	1
5年超10年以下	4250	4,250	10 17 24 29	11月24日	1
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	-
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