



短期市場の推移

	11月10日	11月11日	11月14日	11月15日
加重平均金利	▲0.066	▲0.068	▲0.067	▲0.067
東京レボレート(TN)	▲0.087	▲0.084	▲0.085	▲0.087
無コール残	134,518	138,493	136,702	127,612
ON	72,411	76,336	72,745	63,505
その他	62,107	62,157	63,957	64,107
有コール残	30,950	30,998	31,295	29,686

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	▲0.087	0.001	▲0.070	▲0.085
T/N	-	-	-	▲0.087
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.068	▲0.020	▲0.051	▲0.094
2W	▲0.070	0.180	▲0.049	▲0.099
3W	-	-	-	▲0.106
1M	▲0.068	▲0.030	▲0.046	▲0.112
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.126
6M	-	-	-	▲0.133
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17日の予定 (時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
8:50	10月貿易収支	-17315億円	22:30	(米)新規失業保険申請件数 [前週分]	-
	-		22:30	(米)10月住宅着工件数	142.5万戸
	-		22:30	(米)11月フィラデルフィア連銀製造業景況指数	-5.0

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▲0.073%の割合から始まり、その後は主に▲0.075%~▲0.070%の水準で取引された。積み初日のため、調達サイドは様子見でビッドを控える先も見られ、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.003%の▲0.070%となった。

都銀・信託	証券	地銀
- ~ -	▲ 0.080 ~ ▲ 0.080	▲ 0.078 ~ ▲ 0.065

翌営業日のマーケット

オファー、ビッド共に主だった動態変化は見られないため、本対比横ばいを想定。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	11月16日	11月17日	11月17日	11月18日	11月18日	11月18日
券		+0	▲800	▲1,000		
財政		▲30,000	+2,500	▲8,000		
過不足		▲30,000	+1,700	▲9,000		
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				
共通担保(全店)		+100	▲100			
CP等買入	▲100		▲200			
被災地金融機関支援				▲200	+100	
国債補充供給	+12,400	▲11,000	+11,000			
当座預金増減		▲27,600	+12,400	▲9,100		
当座預金残高		4,894,900	4,907,300	4,898,200		
準備預金残高		4,245,400	主な需給要因			
積み終了先		2,639,000	国債発行(20年)			
超過準備		1,072,700				
非準備預金残高		649,500				
準備預金進捗率		84.2%				
平均		3.3%				
乖離率		80.9%				

11月16日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
国債買入(固定利回り方式)(11/17~)						
5~10年	0	0				
5~10年	0	0				
国債補充供給(11/16~11/17)						
	10,886	10,886	▲0.350	▲0.350		
	0	0				
共通担保(全店)(11/16~11/17)						
	1,000	54	54			

マネタリーベース 【億円】
11月15日時点 6,176,300

所要	【億円】
今積期の所要準備額	3,767,900
11月17日以降の残り所要	
積数	595,200
平均	20,500

国庫短期証券入札予定

11月17日	1年(第1121回)
11月18日	3ヶ月(第1122回)
11月25日	3ヶ月
12月2日	3ヶ月

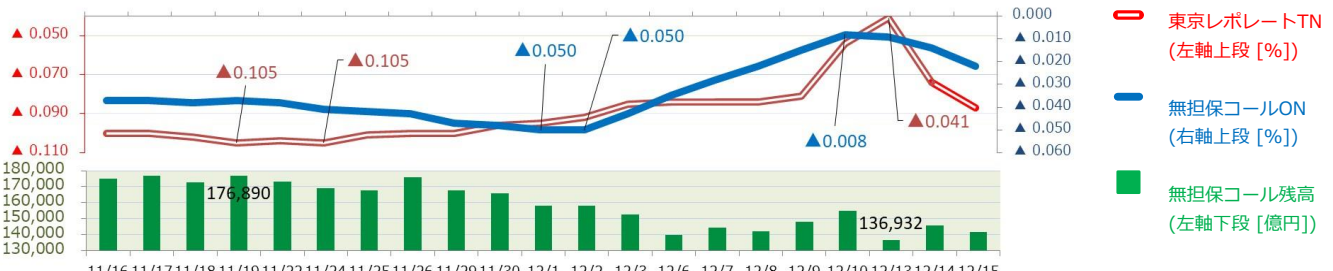
今月の国債買入オペ予定

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	11月2日	0
1年超3年以下	4750	4,750	2 8 14 21	11月14日	1
3年超5年以下	4750	4,750	2 8 21 28	11月8日	2
5年超10年以下	5500	5,500	8 14 21 28	11月14日	2
10年超25年以下	2500	2,500	8 21 28	11月8日	2
25年超	1000	1,000	2 14 28	11月14日	1
物価連動債	600	600	月1回	11月14日	0
変動利付債<四半期>	300	300	四半期に1回	10月17日	0

1年前の市場推移

○2021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