



短期市場の推移

	11月14日	11月15日	11月16日	11月17日
加重平均金利	▲0.067	▲0.067	▲0.070	▲0.071
東京レボレート(TN)	▲0.085	▲0.087	▲0.087	▲0.089
無コール残	136,702	127,612	121,678	129,534
ON	72,745	63,505	61,086	65,892
その他	63,957	64,107	60,592	63,642
有コール残	31,295	29,686	31,473	30,900

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	▲0.071	▲0.085
T/N	-	-	-	▲0.088
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.073	0.008	▲0.067	▲0.094
2W	▲0.073	▲0.063	▲0.067	▲0.099
3W	-	-	▲0.069	▲0.107
1M	▲0.068	0.060	▲0.042	▲0.115
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.126
6M	-	-	-	▲0.132
1Y	-	-	-	▲0.129

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21日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	シカゴ連銀全米活動指数(10月)	-
-	-	-	-
-	-	-	-

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▲0.070%の合出から始まり、その後は主に▲0.075%~▲0.068%の水準で取引された。週末3日積みみではあったものの、ビッドサイドの調達動向に大きな変化はなく、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比横ばいの▲0.071%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.085 ~ ▲0.085	▲0.080 ~ ▲0.070	▲0.075 ~ ▲0.068

翌営業日のマーケット

週明けもビッドサイドの動向に変化はなく、出合いの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18日		11月21日		11月22日	
券	+0		▲100		▲1,000	
財政	▲2,500		+3,800		▲1,000	
過不足	▲2,500		+3,700		▲2,000	
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
CP等買入	▲500	-	▲600	-	-	-
被災地金融機関支援	▲200	+100	-	-	-	-
国債補完供給	+10,700	▲12,200	+12,200	-	-	-
社債等買入	-	-	-	-	-	+1,000
当座預金増減	▲4,600		+15,300		▲1,000	
当座預金残高	4,893,100		4,908,400		4,907,400	
準備預金残高	4,254,000		主な需給要因			
積み終了先	4,249,700		国庫短期証券			
超過準備	4,235,600		発行・償還(3M)			
非準備先残高	639,100		国庫短期証券			
準備預金進捗率	99.2%		発行・償還(1Y)			
平均	16.7%		変動利付国債			
乖離率	82.5%		償還(15年)			

11月18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(固定利回り方式)(11/21~)						
5~10年	0	0				
5~10年	0	0				
国債補完供給(11/18~11/21)						
	11,727	11,727	▲0.350	▲0.350		
	149	149	▲0.350	▲0.350		

マネタリーベース (億円)

11月17日時点 6,152,400

所要

今積期の所要準備額	11月21日以降の残り所要
3,767,900	積数 31,000
	平均 1,200

国庫短期証券入札予定

11月25日	3ヶ月(第1123回)
12月2日	3ヶ月
12月8日	6ヶ月
12月9日	3ヶ月

国債入札予定

11月25日	40年
11月29日	2年
12月1日	10年
12月6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	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