

2020年11月17日(火)

短期市場の推移

[億円] [%]

	11月11日	11月12日	11月13日	11月16日
加重平均金利	▲0.034	▲0.034	▲0.030	▲0.038
東京レポレート(ON)	▲0.083	▲0.086	▲0.088	▲0.084
無コール残	110,073	107,220	119,454	102,163
ON	69,155	67,222	80,751	66,425
その他	40,918	39,998	38,703	35,738
有コール残	20,413	20,217	20,175	20,392

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・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)			レポ市場
	最低	最高	平均	東京レポレート
O/N	▲0.080	0.001	▲0.033	▲0.093
T/N	▲0.025	▲0.001	▲0.004	▲0.094
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.025	▲0.013	▲0.019	▲0.090
2W	▲0.025	▲0.020	▲0.023	▲0.093
3W	-	-	-	▲0.096
1M	-	-	▲0.023	▲0.100
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.113
6M	-	-	-	▲0.135
1Y	-	-	-	▲0.158

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18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	2500億円	22:30	(米)10月住宅建設許可件数
	-	-	22:30	(米)10月住宅着工件数
	-	-		157万戸
	-	-		144.8万戸

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▲0.025%の出合から始まり、その後は主に▲0.065%~▲0.020%の水準で出合が見られた。
同加重平均金利(速報)は、前営業日対比+0.005%の▲0.033%となった。

[%]

都銀・信託	証券	地銀
▲0.070 ~ ▲0.065	▲0.070 ~ ▲0.040	▲0.050 ~ ▲0.020

翌営業日のマーケット

出合水準は、本日対比で概ね横ばいを想定。

資金需給

[億円]

	日銀速報	日銀予想	当社需給予想
	11月17日	11月18日	11月19日
券	+400	▲200	▲1,000
財政	▲2,900	▲2,100	+2,000
過不足	▲2,500	▲2,300	+1,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国庫短期証券買入		+10,000	
国債買入		+13,600	
共通担保(全店)		+1,400	
CP等買入	▲200	▲800	
ETF買入			
国債補完供給	+600	▲500	+500
当座預金増減	▲1,800	+20,800	+1,000
当座預金残高	4,801,000	4,821,800	4,822,800
準備預金残高	4,200,100	主な需給要因	
積み終了先	4,146,400		
超過準備	3,770,500		
非準備先残高	600,900		
準備預金進捗率	98.7%		
平均	6.7%		
乖離率	92.1%		

11月17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
国庫短期証券買入(11/18~)	10,000	31,004	10,005	0.003	0.005	9.9
国債買入(11/18~)						
1~3年	5,000	11,438	5,004	▲0.003	▲0.001	92.8
3~5年	4,200	11,975	4,205	0.002	0.003	63.0
5~10年	4,200	13,099	4,211	▲0.002	▲0.002	77.5
米ドル資金供給(11/19~11/27)						
	0	0	0.340	0.340		
米ドル資金供給(11/19~2/12)						
	0	0	0.330	0.330		
国債補完供給(11/17~11/18)						
	527	527	▲0.350	▲0.350		
	0	0				
共通担保(全店)(11/18~12/2)						
	20,000	1,404	1,404			

マネタリーベース [億円]
11月16日時点 5,988,900

所要 [億円]
今積期の所要準備額 3,451,500
11月18日以降の残高所要
積数 43,300
平均 1,500

国庫短期証券入札予定

11月19日 1年 第952回	
11月20日 3ヶ月 第953回	
11月24日 6ヶ月 第954回	
11月27日 3ヶ月	
国債入札予定	
11月18日 20年	
11月25日 40年	
11月27日 2年	
12月1日 10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	1,000~2,000	1,500	月2回程度	11月9日	1
1年超3年以下	3,500~6,500	5,000	5 11 17 24 26	11月17日	2
3年超5年以下	2,500~6,000	4,200	5 11 17 24 30	11月17日	2
5年超10年以下	2,500~6,000	4,200	9 11 17 24 26	11月17日	2
10年超25年以下	500~2,000	1,200	9 26	11月9日	1
25年超	0~500	300	5 30	11月5日	1
物価連動債	300	300	月2回程度	11月11日	1
変動利付債<偶数月>	500	500	月1回	10月7日	-

1年前の市場推移

○2019年11月積み期 [11月15日~12月13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