

### 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	▲0.038	▲0.033	▲0.035	▲0.034
東京レポレート(ON)	▲0.084	▲0.093	▲0.087	▲0.100
無コール残	102,163	96,181	108,290	109,162
ON	66,425	58,018	69,282	66,954
その他	35,738	38,163	39,008	42,208
有コール残	20,392	20,033	21,052	20,837

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。

### 11月24日の予定(時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
14:30	10月の全国百貨店売上高(百貨店協会)	(米)11月の消費者信頼感指数	
	-	(米)セントルイス連銀総裁の講演	
	-	-	

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	▲0.081
T/N	▲0.025	▲0.001	▲0.007	▲0.081
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.025	▲0.015	▲0.021	▲0.087
2W	▲0.035	▲0.020	▲0.025	▲0.093
3W	-	-	-	▲0.094
1M	-	-	-	▲0.100
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.111
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

### 本日の市況

本日の無担保コールON物は▲0.020%の出合から始まり、その後は主に▲0.060%~▲0.015%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+0.001%の▲0.033%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.055 ~ ▲0.050	- ~ -	▲0.050 ~ ▲0.015

### 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

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想
	11月20日	11月24日	11月24日	11月25日	11月25日
券	▲1,000	+200		+0	+0
財政	▲8,200	▲2,200		▲25,000	▲25,000
過不足	▲9,200	▲2,000		▲25,000	▲25,000
金融調節	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド
CP等買入	▲1,400		▲500		
社債等買入	▲100	+2,000			
ETF買入		+700			
国債補完供給	+300	▲700	+700		
当座預金増減	▲8,400	▲1,800	▲25,000		
当座預金残高	4,813,500	4,811,700	4,786,700		
準備預金残高	4,237,600	主な需給要因			
積み終了先	4,237,200				
超過準備	4,235,600				
非準備先残高	575,900	国庫短期証券	国庫短期証券		
準備預金進捗率	99.9%	発行・償還(3M)	発行・償還(6M)		
平均	26.7%				
乖離率	73.2%				

### 11月20日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	接分
国債補完供給(11/20~11/24)	648	648	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マナタリーベース [億円]  
11月19日時点 6,009,200

所要 [億円]  
今積期の所要準備額 3,451,500  
11月24日以降の残り所要積数 3,000  
平均 100

### 国庫短期証券入札予定

11月24日	6ヶ月	第954回
11月27日	3ヶ月	第955回
12月4日	3ヶ月	
12月9日	6ヶ月	
11月25日	40年	
11月27日	2年	
12月1日	10年	
12月3日	30年	

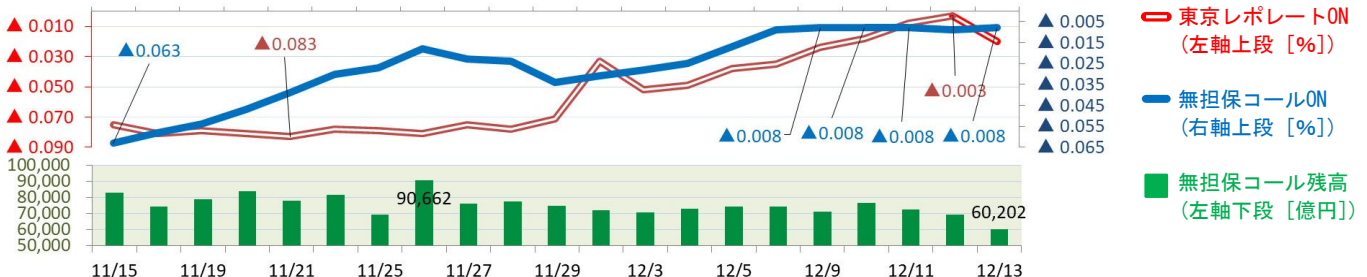
### 今月の国債買入オペ予定

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	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。