

短期市場の推移

[億円] [%]

	11月17日	11月18日	11月19日	11月20日
加重平均金利	▲0.033	▲0.035	▲0.034	▲0.033
東京レポレート(ON)	▲0.093	▲0.087	▲0.100	▲0.081
無コール残	96,181	108,290	109,162	124,507
ON	58,018	69,282	66,954	80,109
その他	38,163	39,008	42,208	44,398
有コール残	20,033	21,052	20,837	22,589

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25日の予定(時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
10:00 営業毎旬報告(11月20日現在)	-	0:00 (米)11月消費者信頼感指数	98.0
-	-	22:30 (米)10月耐久財受注[前月比]	1.0%
-	-	22:30 (米)10月個人消費支出(PCE) 価格コア指数[前年比]	1.4%

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	▲0.075	0.001	▲0.031	▲0.081
T/N	▲0.025	▲0.001	▲0.007	▲0.080
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.030	▲0.018	▲0.020	▲0.085
2W	-	-	▲0.025	▲0.089
3W	0.000	0.020	0.008	▲0.094
1M	-	-	-	▲0.099
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.111
6M	-	-	-	▲0.134
1Y	-	-	-	▲0.157

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+0.002%の▲0.031%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.060 ~ ▲0.050	- ~ -	▲0.055 ~ ▲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

[億円]

	日銀速報	日銀予想	当社需給予想
	11月24日	11月25日	11月26日
券	+100	+0	▲1,000
財政	▲5,600	▲24,400	▲4,000
過不足	▲5,500	▲24,400	▲5,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国債買入			+13,600
CP等買入	▲500	▲1,000	
社債等買入		▲200	
ETF買入			+400
国債補完供給	+700	▲300	+300
新型コロナ対応金融支援特別			+37,400
当座預金増減	▲5,600	+26,100	▲5,000
当座預金残高	4,807,900	4,834,000	4,829,000
準備預金残高	4,213,500		
積み終了先	4,213,100		
超過準備	4,213,100		
非準備先残高	594,400		
準備預金進捗率	99.9%		
平均	30.0%		
乖離率	69.9%		

11月24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(11/25~)						
1~3年	5,000	12,154	5,002	0.005	0.006	76.1
3~5年	4,200	11,969	4,202	0.011	0.012	80.9
5~10年	4,200	12,907	4,207	0.009	0.009	99.1
米ドル資金供給(11/27~12/3)						
		0	0	0.340	0.340	
米ドル資金供給(11/27~2/19)						
		0	0	0.330	0.330	
国債補完供給(11/24~11/25)						
		0	0			
		239	239	▲0.350	▲0.350	
新型コロナ対応金融支援特別(11/25~5/25)						
		37,381	37,381			

マネタリーベース [億円]
11月20日時点 6,001,800

所要 [億円]
今積期の所要準備額 3,451,500
11月25日以降の残り所要
積数 2,700
平均 100

国庫短期証券入札予定

11月27日 3ヶ月 第955回
12月4日 3ヶ月
12月9日 6ヶ月
12月11日 3ヶ月
国債入札予定
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24日	1
3年超5年以下	2,500~6,000	4,200	5 11 17 24 30	11月24日	1
5年超10年以下	2,500~6,000	4,200	9 11 17 24 26	11月24日	1
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。