

# DAILY SIGNAL 上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

2020年11月27日(金)

## 短期市場の推移 [億円] [%]

	11月20日	11月24日	11月25日	11月26日
加重平均金利	▲0.033	▲0.031	▲0.030	▲0.030
東京レポレート(ON)	▲0.081	▲0.081	▲0.079	▲0.078
無コール残	124,507	104,410	102,138	106,857
ON	80,109	65,392	61,220	65,459
その他	44,398	39,018	40,918	41,398
有コール残	22,589	22,414	22,276	21,699

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30日の予定(時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
8:50	10月鉱工業生産指数 [前月比]	+2.1%	23:45	(米)11月MNIシカゴ購買 部協会景気指数	59.2
	-		10:00	(中)11月製造業PMI	51.5
	-		10:00	(中)11月非製造業PMI	56.0

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	▲0.030	▲0.079
T/N	▲0.020	▲0.001	▲0.003	▲0.077
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.050	▲0.003	▲0.023	▲0.084
2W	-	-	▲0.020	▲0.087
3W	-	-	-	▲0.090
1M	-	-	▲0.010	▲0.097
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.108
6M	-	-	-	▲0.131
1Y	-	-	-	▲0.154

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▲0.015%の出合から始まり、その後は▲0.050%~▲0.015%の水準で出合が見られた。同加重平均金利(速報)は、前営業日対比横這いの▲0.030%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.050 ~ ▲0.040	- ~ -	▲0.045 ~ ▲0.015

## 翌営業日のマーケット

月末跨ぎにつき、ビッドサイドのやや慎重な動きが想定され、出合水準は本日対比で低下すると思われる。

## 資金需給 [億円]

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	11月27日	11月30日	11月30日	12月1日	12月1日	12月1日
券	▲1,000	▲400	▲1,000	▲1,000	▲1,000	▲1,000
財政	▲300	+7,700	+7,700	+7,700	+7,700	+7,700
過不足	▲1,300	+7,300	+7,300	+7,300	+7,300	+7,300
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		+25,000				
国債買入		+11,000				
CP等買入	▲700	+6,000	▲4,900			
社債等買入	▲200					
ETF買入				+100		
国債補完供給	▲300	+300				
当座預金増減	+39,500	+2,800	+2,800	▲26,000	▲26,000	▲26,000
当座預金残高	4,868,100	4,870,900	4,870,900	4,844,900	4,844,900	4,844,900
準備預金残高	4,275,000	主な需給要因				
積み終了先	4,274,700					
超過準備	4,274,700					
非準備預金残高	593,100	国庫短期証券	国債発行・償還			
準備預金進捗率	99.9%	発行・償還(3M)	(2年)			
平均	46.7%					
乖離率	53.2%					

## 11月27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	接分
国債補完供給(11/27~11/30)	260	260	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マナタリーベース [億円]  
11月26日時点 6,018,300

所要 [億円]  
今積期の所要準備額 3,451,500  
11月30日以降の残り所要積数 900  
平均 100

## 国庫短期証券入札予定

12月4日	3ヶ月	第956回
12月9日	6ヶ月	
12月11日	3ヶ月	
12月15日	6ヶ月	
12月1日	10年	
12月3日	30年	
12月8日	5年	
12月10日	20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26日	0
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26日	0
10年超25年以下	500~2,000	1,200	9 26	11月26日	0
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26日	0
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。