



### 短期市場の推移

	11月9日	11月10日	11月11日	11月12日
加重平均金利	▲0.051	▲0.049	▲0.047	▲0.038
東京レボレート(TN)	▲0.086	▲0.086	▲0.085	▲0.085
無コール残	142,751	151,154	141,261	146,944
ON	61,093	68,626	67,083	72,866
その他	81,658	82,528	74,178	74,078
有コール残	17,899	18,858	19,198	18,308

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	▲0.075	0.001	▲0.030	▲0.085
T/N	-	-	▲0.035	▲0.100
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	▲0.025	▲0.101
2W	▲0.050	0.010	▲0.029	▲0.101
3W	-	-	-	▲0.103
1M	-	-	-	▲0.105
2M	-	-	-	-
3M	-	-	0.005	▲0.113
6M	-	-	-	▲0.121
1Y	-	-	-	▲0.131

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16日の予定 (時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
17:00	10月の業感別の日銀当座預金残高(日銀)		19:00	(欧)7-9月期域内総生産(GDP)改定値[前年比]	3.7%
	-		23:15	(米)10月鉱工業生産指数[前月比]	0.8%
	-			-	

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%の出会いから始まり、その後は主に▲0.060%~▲0.008%の水準で出会いが見られた。積み最終日を迎え、着地に向けた調整で取り上がる動きが一部で見られ、本日の同加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.008%の▲0.030%となった。

都銀・信託		証券	地銀
▲0.060 ~ ▲0.050		▲0.025 ~ ▲0.025	▲0.040 ~ ▲0.008

### 翌営業日のマーケット

新積み期に入り運用ニーズが増進する先が予想され、出会い水準は本日対比で低下すると予想。

### 資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	11月15日	11月16日	11月16日	11月17日	11月17日	11月17日
券		+400	+600		▲1,000	
財政		+7,600	+1,600		▲29,000	
過不足		+8,000	+2,200		▲30,000	
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	▲800	▲200	+5,000			
国債補充供給	▲900	+900				
当座預金増減		+6,300	+7,900		▲30,000	
当座預金残高		5,379,800	5,387,700		5,357,700	
準備預金残高		4,813,900				主な需給要因
積み終了先		4,813,900				国債発行(5年)
超過準備		4,813,900				
非準備先残高		565,900				
準備預金進捗率		100.0%				
平均		100.0%				
乖離率		0.0%				

### 11月15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
国債補充供給(11/15~11/16)	887	887	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マナリーベース (億円)  
11月12日時点 6,595,400

所要	(億円)
来積期の所要準備額	3,633,000
11月16日以降の残り所要	
積数	3,633,000
平均	121,100

### 国庫短期証券入札予定

11月18日	1年(第1038回)
11月19日	3ヶ月(第1039回)
11月24日	6ヶ月
11月26日	3ヶ月
11月16日	5年
11月18日	20年
11月25日	40年
11月30日	2年

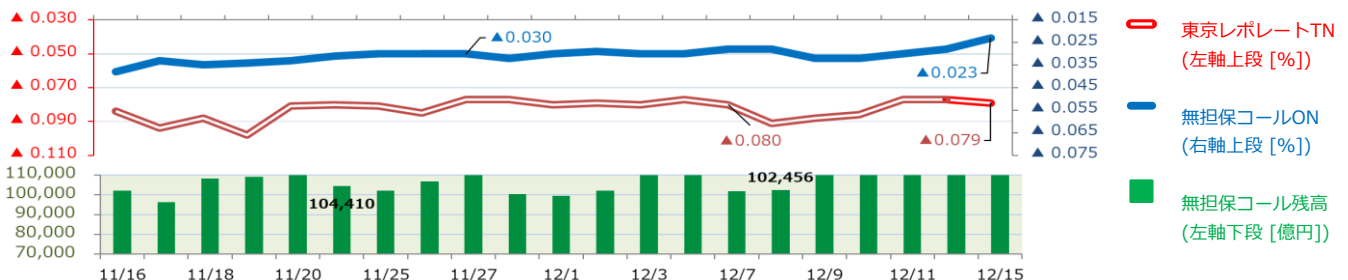
### 今月の国債買入オペ予定

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	10月8日	1
1年超3年以下	4500	4,500	2 10 17 24	11月10日	2
3年超5年以下	4500	4,500	2 10 24 29	11月10日	2
5年超10年以下	4250	4,250	10 17 24 29	11月10日	3
10年超25年以下	1500	1,500	2	11月2日	0
25年超	500	500	17	10月20日	1
物価連動債	600	600	月1回	10月26日	1
変動利付債<四半期>	300	300	四半期に1回	10月13日	-

### 1年前の市場推移

○2020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