



短期市場の推移

	11月10日	11月11日	11月12日	11月15日
加重平均金利	▲0.049	▲0.047	▲0.038	▲0.030
東京レポレート(TN)	▲0.086	▲0.085	▲0.085	▲0.100
無コール残	151,154	141,261	146,944	135,176
ON	68,626	67,083	72,866	63,898
その他	82,528	74,178	74,078	71,278
有コール残	18,858	19,198	18,308	18,634

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	▲0.086	0.001	▲0.037	▲0.094
T/N	▲0.060	▲0.040	▲0.053	▲0.100
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.010	▲0.003	▲0.009	▲0.101
2W	▲0.045	▲0.001	▲0.030	▲0.101
3W	-	-	▲0.020	▲0.103
1M	▲0.020	0.011	▲0.006	▲0.104
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.114
6M	-	-	-	▲0.122
1Y	-	-	-	▲0.131

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17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	-1693億円	16:00	(英)10月消費者物価コア指数[前年比]	-
	-			-	
	-			-	

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。新積み期に入り運用サイドの放出ニーズが強く、本日の同加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.007%の▲0.037%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.085 ~ ▲0.080	▲0.040 ~ ▲0.040	▲0.040 ~ ▲0.001

翌営業日のマーケット

大きな地合の変化はなく、出合水準は本日対比横ばいを予想。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	11月16日	11月17日	11月17日	11月18日	11月18日	11月19日
券	+600		▲200		▲1,000	
財政	+1,000		▲30,800		+2,000	
過不足		+1,600		▲31,000		+1,000
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
国庫短期証券買入				+1,000		
CP等買入	▲200	+5,000	▲200			
国債補完供給	+900	▲300	+300			
当座預金増減		+7,000		▲29,900		+1,000
当座預金残高		5,386,800		5,356,900		5,357,900
準備預金残高		4,746,100		主な需給要因		
積み終了先		3,529,600		国債発行(5年)		
超過準備		1,446,900				
非準備先残高		640,700				
準備預金進捗率		90.8%				
平均		3.3%				
乖離率		87.5%				

11月16日のオペ結果

オベ種類 オファー 応札 落札 足切 平均 按分

国庫短期証券買入(11/17~)
 1,000 6,336 1,000 0.008 0.009 33.0

米ドル資金供給(11/18~11/26)
 1 1 0.330 0.330

国債補完供給(11/16~11/17)
 292 292 ▲0.350 ▲0.350
 0 0

米ドル資金供給用担保国債供給(11/17~11/29)
 5,000 2 2 ▲0.100 ▲0.100

マネタリーベース (億円)
 11月15日時点 6,601,300

所要 (億円)
 今積期の所要準備額 3,633,000
 11月17日以降の残り所要
 積数 333,800
 平均 11,500

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

国債入札予定

11月18日	20年
11月25日	40年
11月30日	2年
12月2日	10年

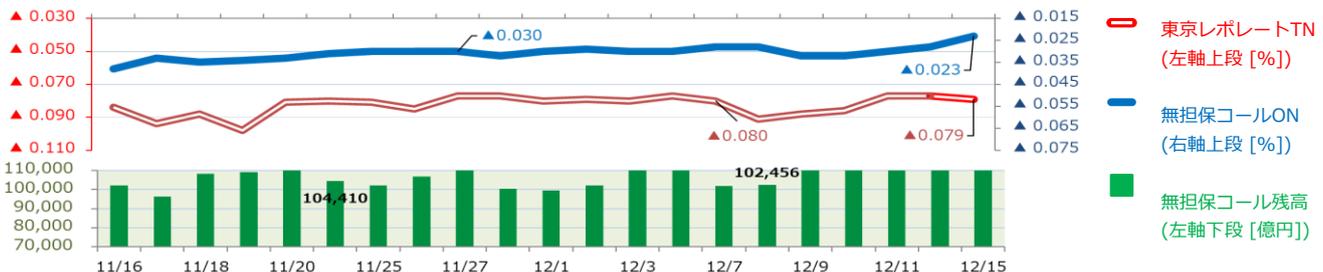
今月の国債買入オペ予定

オベ種類	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