



短期市場の推移

	11月12日	11月15日	11月16日	11月17日
加重平均金利	▲0.038	▲0.030	▲0.037	▲0.037
東京レポレート(TN)	▲0.085	▲0.100	▲0.100	▲0.100
無コール残	146,944	135,176	174,838	176,711
ON	72,866	63,898	97,320	95,743
その他	74,078	71,278	77,518	80,968
有コール残	18,308	18,634	17,614	18,226

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	▲0.038	▲0.097
T/N	-	-	▲0.040	▲0.102
S/N	-	-	▲0.005	-
1W	▲0.030	▲0.002	▲0.024	▲0.102
2W	▲0.030	▲0.001	▲0.015	▲0.103
3W	-	-	-	▲0.104
1M	▲0.020	0.150	0.011	▲0.106
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.115
6M	-	-	-	▲0.123
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19日の予定 (時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
8:30	10月消費者物価コア指数 [前年比]	+0.1%	-	-	-
			-	-	-
			-	-	-

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▲0.040%の出合いから始まり、その後は主に▲0.040%~▲0.020%の水準で出合いが見られた。調達サイドの動向に大きな変化はなく、本日の同加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.001%の▲0.038%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.080 ~ ▲0.080	~	▲0.040 ~ ▲0.017

翌営業日のマーケット

週末3日積みにより調達意欲が高まると思われる、出合水準は本日対比上昇を予想。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	11月18日	11月19日	11月19日	11月22日	11月22日	11月22日
券	▲1,200	▲400	▲400	+1,000	+1,000	
財政	+2,000	▲4,900	▲4,900	▲7,000	▲7,000	
過不足	+800	▲5,300	▲5,300	▲6,000	▲6,000	
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
国債買入		+9,300				
共通担保(全店)	▲100		▲1,000			
CP等買入	▲200					
国債補充供給	+500	▲100	+100			
新型コロナ対応金融支援特別			▲100			
当座預金増減	+10,200	▲6,300	▲6,300	▲6,000	▲6,000	
当座預金残高	5,367,100	5,360,800	5,360,800	5,354,800	5,354,800	
準備預金残高	4,724,300					
積み終了先	4,722,900		国債発行(20年)	国債償還(15年)		
超過準備	4,719,100			国庫短期証券発行・償還(3M、1Y)		
非準備先残高	642,800					
準備預金進捗率	99.8%					
平均	10.0%					
乖離率	89.8%					

11月18日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
社債等買入(11/24~)	750	2,119	752	0.113	0.121	4.7
国債補充供給(11/18~11/19)	120	120	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マネタリーベース

11月17日時点 6,578,000

所要

今積期の所要準備額	3,633,000
11月19日以降の残り所要	
積数	6,600
平均	200

国庫短期証券入札予定

11月19日	3ヶ月(第1039回)
11月24日	6ヶ月(第1040回)
11月26日	3ヶ月
12月3日	3ヶ月
11月25日	40年
11月30日	2年
12月2日	10年
12月7日	30年

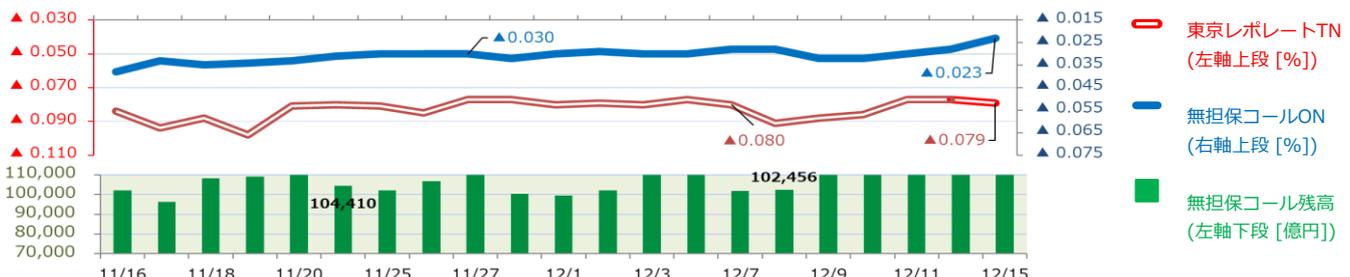
今月の国債買入オペ予定

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	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17日	1
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17日	2
10年超25年以下	1500	1,500	2 17	11月2日	0
25年超	500	500	17	11月17日	0
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