

# DAILY SIGNAL 上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

2020年11月13日(金)

## 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	▲0.030	▲0.034	▲0.034	▲0.034
東京レポレート(ON)	▲0.091	▲0.084	▲0.083	▲0.086
無コール残	121,665	116,380	110,073	107,220
ON	73,727	75,597	69,155	67,222
その他	47,938	40,783	40,918	39,998
有コール残	20,449	20,131	20,413	20,217

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16日の予定(時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
8:50	7-9月期国内総生産(GDP)速報値[前期比年率]	+18.9%	22:30	(米)11月ニューヨーク連銀製造業景気指数	13.8
17:00	業態別の日銀当座預金残高(10月)	-			

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	▲0.070	0.001	▲0.030	▲0.088
T/N	-	-	▲0.001	▲0.081
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.025	▲0.020	▲0.021	▲0.088
2W	▲0.035	▲0.012	▲0.020	▲0.090
3W	-	-	-	▲0.095
1M	▲0.020	▲0.005	▲0.012	▲0.100
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.110
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協会公表

## 本日の市況

本日の無担保コールON物は▲0.025%の出合から始まり、その後は主に▲0.045%~▲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+0.004%の▲0.034%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.050 ~ ▲0.040	▲0.035 ~ ▲0.035	▲0.035 ~ ▲0.010

## 翌営業日のマーケット

新積み期初日のためビッドサイドは慎重な動きとなり出合いの水準は低下すると予想。

## 資金需給

	日銀速報	日銀予想	当社需給予想
	11月13日	11月16日	11月17日
券	+200	+800	+0
財政	▲22,500	▲32,900	▲4,000
過不足	▲22,300	▲32,100	▲4,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
CP等買入	▲700	▲1,600	
ETF買入	+100		
国債補完供給	+1,100	+300	
当座預金増減	▲22,100	▲33,400	▲4,000
当座預金残高	4,836,900	4,803,500	4,799,500
準備預金残高	4,252,200	主な需給要因	
積み終了先	4,252,200		
超過準備	4,252,200		
非準備先残高	584,700	国庫短期証券	
準備預金進捗率	100.0%	発行・償還(3M)	
平均	100.0%		
乖離率	0.0%		

## 11月13日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	接分
国債補完供給(11/13~11/16)	273	273	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マナタリーベース [億円]  
11月12日時点 6,046,100

所要 [億円]  
来積期の所要準備額 3,451,500  
11月16日以降の残り所要  
積数 3,451,500  
平均 115,000

## 国庫短期証券入札予定

11月19日	1年	第952回
11月20日	3ヶ月	第953回
11月24日	6ヶ月	
11月27日	3ヶ月	
11月18日	20年	
11月25日	40年	
11月27日	2年	
12月1日	10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11日	3
3年超5年以下	2,500~6,000	4,200	5 11 17 24 30	11月11日	3
5年超10年以下	2,500~6,000	4,200	9 11 17 24 26	11月11日	3
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。