

短期市場の推移

	11月2日	11月4日	11月5日	11月6日
加重平均金利	▲0.030	▲0.032	▲0.031	▲0.029
東京レポレート(ON)	▲0.086	▲0.097	▲0.094	▲0.091
無コール残	120,001	106,368	107,788	134,214
ON	78,618	65,235	64,605	77,481
その他	41,383	41,133	43,183	56,733
有コール残	20,725	19,364	22,316	20,055

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10日の予定(時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
8:50	9月国際収支(経常収支)	19776億円	-	-
	-	-	-	-
	-	-	-	-

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	0.030	▲0.030	▲0.091
T/N	▲0.045	0.030	▲0.015	▲0.085
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.035	▲0.020	▲0.024	▲0.090
2W	-	-	-	▲0.093
3W	-	-	-	▲0.096
1M	-	-	-	▲0.100
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.112
6M	-	-	-	▲0.133
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業協会公表

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▲0.050%~▲0.020%の水準で出合が見られた。同加重平均金利(速報)は、前営業日比▲0.001%の▲0.030%となった。また、日銀は当座預金のマクロ加算残高にかかる基準比率を見直し、11月積み期間は15.0%(前回20.5%)とした。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.050 ~ ▲0.045	▲0.035 ~ ▲0.035	▲0.040 ~ ▲0.020

翌営業日のマーケット

出合水準は、積み期終盤に入り資金調達を控える先も出てき、若干の低下を予想。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	11月9日	11月10日	11月10日	11月11日	11月11日	11月11日
券		+700		+600		+0
財政		▲21,000		▲22,100		▲7,000
過不足		▲20,300		▲21,500		▲7,000
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				+7,300		
CP等買入	▲100		▲600			
社債等買入		+3,000				
国債補充供給	+700	▲700	+700			
当座預金増減		▲17,400		▲14,100		▲7,000
当座預金残高		4,842,200		4,828,100		4,821,100
準備預金残高		4,230,700	主な需給要因			
積み終了先		4,230,600				
超過準備		4,230,600				
非準備先残高		611,500	国庫短期証券		国債発行(30年)	
準備預金進捗率		100.0%	発行・償還(6M)			
平均		80.6%				
乖離率		19.4%				

11月9日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	接分
国債買入(11/10~)						
~1年	1,500	3,523	1,502	0.001	0.005	57.7
5~10年	4,200	10,193	4,207	0.006	0.008	30.1
10~25年	1,200	4,056	1,208	0.013	0.014	84.4
国債補充供給(11/9~11/10)						
		725	725	▲0.350	▲0.350	
		0	0			

マナタリーベース [億円]
11月6日時点 6,048,500

所要 [億円]
今積期の所要準備額 3,545,200
11月10日以降の残り所要積数 0
平均 0

国庫短期証券入札予定

11月13日	3ヶ月	第951回
11月19日	1年	
11月20日	3ヶ月	
11月24日	6ヶ月	
国債入札予定		
11月10日	30年	
11月12日	5年	
11月18日	20年	
11月25日	40年	

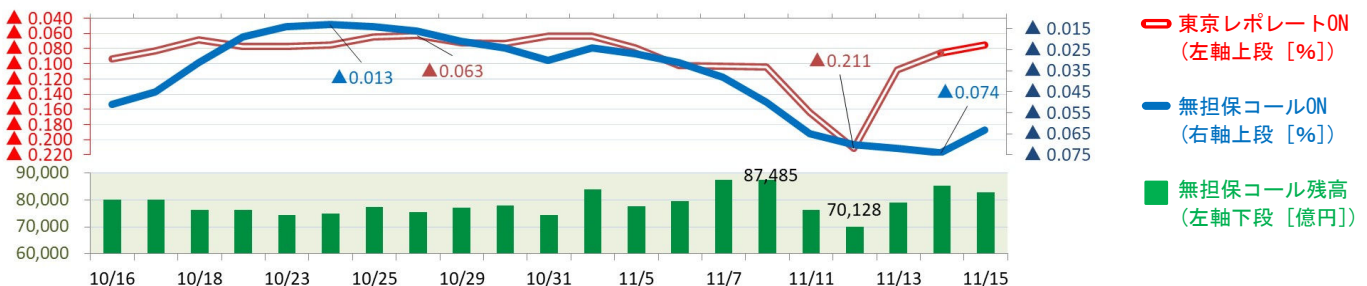
今月の国債買入オペ予定

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5日	4
3年超5年以下	2,500~6,000	4,200	5 11 17 24 30	11月5日	4
5年超10年以下	2,500~6,000	4,200	9 11 17 24 26	11月9日	4
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	10月21日	2
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10月積み期 [10月16日~11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。