

短期市場の推移

	11月6日	11月9日	11月10日	11月11日
加重平均金利	▲0.029	▲0.030	▲0.034	▲0.034
東京レポレート(ON)	▲0.091	▲0.091	▲0.084	▲0.083
無コール残	134,214	121,665	116,380	110,073
ON	77,481	73,727	75,597	69,155
その他	56,733	47,938	40,783	40,918
有コール残	20,055	20,449	20,131	20,413

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13日の予定(時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	(欧)7-9月期域内総生産(GDP)改定値[前年比]	-4.3%
-	-	(米)10月生産者物価コア指数[前年比]	1.2%
-	-	-	-

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	▲0.034	▲0.086
T/N	▲0.055	▲0.001	▲0.022	▲0.087
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.025	▲0.018	▲0.022	▲0.089
2W	▲0.030	0.001	▲0.020	▲0.090
3W	-	-	-	▲0.094
1M	▲0.030	0.013	0.002	▲0.100
2M	-	-	-	-
3M	-	-	0.005	▲0.111
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▲0.060%~▲0.020%の水準で出合が見られた。同加重平均金利(速報)は、前営業日対比横ばいの▲0.034%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.055 ~ ▲0.050	- ~ -	▲0.060 ~ ▲0.020

翌営業日のマーケット

積み期最終日にかかる3日積みであるため調達を控える先が多く地合は弱含むと予想。

資金需給

	日銀速報	日銀予想	当社需給予想
	11月12日	11月13日	11月16日
券	▲300	+200	+1,000
財政	+4,200	▲24,100	▲34,000
過不足	+3,900	▲23,900	▲33,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国庫短期証券買入		+15,000	
国債買入		+13,900	
CP等買入	▲500	+5,500	▲700
ETF買入		+100	+100
国債補完供給	+300	▲1,100	
当座預金増減	+37,100	▲23,400	▲33,000
当座預金残高	4,859,000	4,835,600	4,802,600
準備預金残高	4,259,000	主な需給要因	
積み終了先	4,259,000	国債発行(5年)	
超過準備	4,259,000	国庫短期証券発行・償還(3M)	
非準備先残高	600,000		
準備預金進捗率	100.0%		
平均	90.3%		
乖離率	9.7%		

11月12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(11/12~11/13)	684	684	▲0.350	▲0.350		
	372	372	▲0.350	▲0.350		

マナタリーベース [億円]
11月11日時点 6,008,700

所要	[億円]
今積期の所要準備額	3,545,200
11月13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	第952回
11月20日	3ヶ月	
11月24日	6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。