

短期市場の推移

	11月10日	11月11日	11月12日	11月13日
加重平均金利	▲0.034	▲0.034	▲0.034	▲0.030
東京レポレート(ON)	▲0.084	▲0.083	▲0.086	▲0.088
無コール残	116,380	110,073	107,220	119,454
ON	75,597	69,155	67,222	80,751
その他	40,783	40,918	39,998	38,703
有コール残	20,131	20,413	20,217	20,175

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17日の予定(時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	22:30 (米)10月小売売上高	0.5%
-	-	23:15 (米)10月鉱工業生産指数 [前月比]	1.0%
-	-	23:15 (米)9月設備稼働率	72.3%

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	▲0.075	0.001	▲0.038	▲0.084
T/N	-	-	▲0.001	▲0.084
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.030	▲0.015	▲0.020	▲0.088
2W	▲0.030	0.000	▲0.018	▲0.091
3W	-	-	-	▲0.095
1M	▲0.030	▲0.018	▲0.025	▲0.100
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.109
6M	-	-	-	▲0.134
1Y	-	-	-	▲0.158

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▲0.040%の出合から始まり、その後は主に▲0.070%~▲0.015%と幅広い水準で出合が見られた。新積み期初日ということもあり、大手行を中心としたビッドサイドの調達姿勢が消極的であったため、出合水準は低下。同加重平均金利(速報)は、前営業日対比▲0.008%の▲0.038%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.070 ~ ▲0.065	▲0.055 ~ ▲0.055	▲0.060 ~ ▲0.015

翌営業日のマーケット

出合水準は、本日対比で概ね横ばいを想定。

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		+800		+400		+0
財政		▲33,000		▲6,100		▲1,000
過不足		▲32,200		▲5,700		▲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
共通担保(全店)						▲1,600
CP等買入	▲1,600		▲200			
ETF買入					+800	
国債補完供給	+300	▲600	+600			
当座預金増減		▲34,100		▲4,500		▲2,600
当座預金残高		4,802,800		4,798,300		4,795,700
準備預金残高		4,211,100		主な需給要因		
積み終了先		2,904,100				
超過準備		1,227,600				
非準備預先残高		591,700				
準備預金進捗率		86.4%				
平均		3.3%				
乖離率		83.1%				

11月16日のオペ結果 [%] [億円] ※米ドル資金供給は百万\$

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	接分
国債補完供給(11/16~11/17)	632	632	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マナタリーベース [億円]
11月13日時点 6,023,900

所要 [億円]
今積期の所要準備額 3,451,500
11月17日以降の残り所要積数 467,900
平均 16,100

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。