

短期市場の推移

	11月13日	11月16日	11月17日	11月18日
加重平均金利	▲0.030	▲0.038	▲0.033	▲0.035
東京レポレート(ON)	▲0.088	▲0.084	▲0.093	▲0.087
無コール残	119,454	102,163	96,181	108,290
ON	80,751	66,425	58,018	69,282
その他	38,703	35,738	38,163	39,008
有コール残	20,175	20,392	20,033	21,052

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20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]	▲0.7%	0:00	(米)10月景気先行指数	0.6%
	-		0:00	(米)10月中古住宅販売 件数	644万件
	-			-	

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	▲0.080	0.001	▲0.034	▲0.100
T/N	▲0.050	▲0.001	▲0.010	▲0.098
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.028	▲0.012	▲0.021	▲0.093
2W	▲0.030	0.020	▲0.020	▲0.095
3W	-	-	0.001	▲0.097
1M	-	-	0.020	▲0.101
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.113
6M	-	-	-	▲0.135
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%~▲0.015%の水準で出合が見られた。同加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.001%の▲0.034%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.060 ~ ▲0.058	▲0.040 ~ ▲0.040	▲0.050 ~ ▲0.015

翌営業日のマーケット

4日積みということもあり、ビッドサイドの取り上がる動きが予想され、出合水準は、本日対比やや上昇すると思われる。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	11月19日	11月20日	11月20日	11月21日	11月24日	11月25日
券	▲1,200	▲1,000	▲1,000	▲1,000	+0	+0
財政	+0	▲7,900	▲7,900	▲7,900	▲1,000	▲1,000
過不足	▲1,200	▲8,900	▲8,900	▲8,900	▲1,000	▲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
CP等買入	▲100		▲1,400			
社債等買入			▲100	+2,000		
ETF買入		+700		+700		
国債補完供給	+400	▲300	+300			
当座預金増減	▲500		▲7,400		▲1,000	
当座預金残高	4,821,900		4,814,500		4,813,500	
準備預金残高	4,210,900					
積み終了先	4,205,800					
超過準備	4,204,700					
非準備預金残高	611,000					
準備預金進捗率	99.7%					
平均	13.3%					
乖離率	86.3%					

11月19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(11/19~11/20)	302	302	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マナタリーベース [億円]
11月18日時点 6,008,400

所要 [億円]
今積期の所要準備額 3,451,500
11月20日以降の残り所要積数 11,000
平均 400

国庫短期証券入札予定

11月20日	3ヶ月	第953回
11月24日	6ヶ月	第954回
11月27日	3ヶ月	
12月4日	3ヶ月	
11月25日	40年	
11月27日	2年	
12月1日	10年	
12月3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	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17日	2
3年超5年以下	2,500~6,000	4,200	5 11 17 24 30	11月17日	2
5年超10年以下	2,500~6,000	4,200	9 11 17 24 26	11月17日	2
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<償数月>	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。