

短期市場の推移

[億円] [%]

	11月24日	11月25日	11月26日	11月27日
加重平均金利	▲0.031	▲0.030	▲0.030	▲0.030
東京レポレート(ON)	▲0.081	▲0.079	▲0.078	▲0.079
無コール残	104,410	102,138	106,857	120,085
ON	65,392	61,220	65,459	79,647
その他	39,018	40,918	41,398	40,438
有コール残	22,414	22,276	21,699	20,784

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。

12月1日の予定 (時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
8:30	10月有効求人倍率	3.1倍	19:00	(欧)11月消費者物価コア指数[前年比]
8:30	10月失業率	+1.0%	-	-
			-	-

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	▲0.032	▲0.077
T/N	▲0.020	▲0.001	▲0.003	▲0.077
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.025	▲0.018	▲0.021	▲0.082
2W	-	-	▲0.019	▲0.085
3W	-	-	0.010	▲0.091
1M	-	-	-	▲0.102
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.109
6M	-	-	-	▲0.131
1Y	-	-	-	▲0.155

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▲0.015%の出合から始まり、その後は▲0.050%~▲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▲0.002%の▲0.032%となった。

都銀・信託		証券	地銀
▲0.055 ~ ▲0.050		▲0.045 ~ ▲0.045	▲0.045 ~ ▲0.015

翌営業日のマーケット

調達サイドの動向に大きな変化はなく、本日と同水準での出合を予想する。

資金需給

[億円]

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	11月30日	12月1日	12月1日	12月2日	12月2日	12月2日
券	▲500	▲500	▲500	▲1,000	▲1,000	▲1,000
財政	+5,000	▲32,900	▲32,900	▲91,000	▲91,000	▲91,000
過不足	+4,500	▲33,400	▲33,400	▲92,000	▲92,000	▲92,000
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			+6,100			
共通担保(全店)				▲1,400		
CP等買入	▲4,900		▲400			
ETF買入	+100					
国債補完供給	+300	▲100	+100		▲5,600	+1,700
成長基盤強化支援						
当座預金増減	▲100	▲27,600	▲27,600	▲97,300	▲97,300	▲97,300
当座預金残高	4,868,000	4,840,400	4,840,400	4,743,100	4,743,100	4,743,100
準備預金残高	4,287,900					
積み終了先	4,287,600					
超過準備	4,287,600					
非準備先残高	580,100					
準備預金進捗率	99.9%					
平均	50.0%					
乖離率	49.9%					

11月30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
国債買入(12/1~)						
~1年	1,500	5,396	1,503	0.011	0.030	9.4
3~5年	4,200	8,859	4,205	0.005	0.006	44.4
25年~	300	2,269	304	0.003	0.003	58.0
国債補完供給(11/30~12/1)						
		112	112	▲0.350	▲0.350	
		0	0			

マナタリーベース [億円]	所要 [億円]
11月27日時点 6,058,800	今積期の所要準備額 3,451,500
	12月1日以降の残り所要積数 600
	平均 0

国庫短期証券入札予定

来月の国債買入オペ予定

12月4日	3ヶ月	第956回
12月9日	6ヶ月	
12月11日	3ヶ月	
12月15日	6ヶ月	
国債入札予定		
12月1日	10年	
12月3日	30年	
12月8日	5年	
12月10日	20年	

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	2
1年超3年以下	3,500~6,500	5,000	2 7 11 16 21	11月26日	5
3年超5年以下	2,500~6,000	4,200	2 11 16 21 25	11月24日	5
5年超10年以下	2,500~6,000	4,200	4 11 16 21 25	11月26日	5
10年超25年以下	500~2,000	1,200	4 25	11月26日	2
25年超	0~500	300	7 25	11月5日	2
物価連動債	300	300	月2回程度	11月26日	2
変動利付債<偶数月>	500	500	月1回	10月7日	1

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。