

短期市場の推移

	11月5日	11月6日	11月7日	11月8日
加重平均金利	▲0.027	▲0.031	▲0.038	▲0.050
東京レポレート(ON)	▲0.079	▲0.102	▲0.103	▲0.104
無コール残	77,597	79,599	87,464	87,485
ON	53,577	56,604	63,944	54,545
その他	24,020	22,995	23,520	32,940
有コール残	19,851	18,331	18,756	18,392

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12日の予定(時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
10:00	日銀営業旬報告 (11月10日現在)	(米)クラリダFRB 副議長が講演	
	-	(米)フィデリティ 連銀総裁の講演	
	-	(米)ミネアポリス 連銀総裁の講演	

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	▲0.087	0.001	▲0.065	▲0.164
T/N	-	-	-	▲0.191
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	▲0.040	▲0.168
2W	-	-	▲0.030	▲0.143
3W	-	-	-	▲0.133
1M	-	-	-	▲0.125
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.135
6M	-	-	-	▲0.168
1Y	-	-	-	▲0.189

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▲0.070%の出合から始まり、その後は主に▲0.087%~▲0.050%の水準で取引された。前週末に引き続き、ビッドサイドの調達意欲が弱く、同加重平均金利(速報)は前日対比▲0.015%の▲0.065%と5営業日連続で低下した。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.087 ~ ▲0.087	▲0.080 ~ ▲0.080	▲0.086 ~ ▲0.050

翌営業日のマーケット

引き続きビッドサイドの調達意欲は弱く、軟調な地合を予想。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	11月11日	11月12日	11月12日	11月13日	11月13日	11月13日
券		+1,100	+600	+0	+0	
財政		▲15,300	▲2,800	▲8,000	▲8,000	
過不足		▲14,200	▲2,200	▲8,000	▲8,000	
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				+11,800		
共通担保(全店)	▲5,600	+4,500				
CP等買入	▲100		▲100			
国債補完供給	+200	▲100	+100			
当座預金増減		▲15,300	+9,600	▲8,000		
当座預金残高		4,046,500	4,056,100	4,048,100		
準備預金残高		3,496,400				
積み終了先		3,496,100				
超過準備		3,496,100				
非準備預金残高		550,100				
準備預金進捗率		99.9%				
平均		87.1%				
乖離率		12.8%				

11月11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(11/12~)						
~1年	500	1,820	501	▲0.004	0.003	56.4
1~3年	4,200	6,190	4,201	▲0.019	▲0.012	97.7
3~5年	3,400	7,047	3,405	▲0.012	▲0.010	2.5
5~10年	3,500	9,105	3,506	▲0.010	▲0.009	27.5
国債補完供給(11/11~11/12)						
		54	54	▲0.450	▲0.450	

マナタリーベース	所要
11月8日時点 5,184,700	今積期の所要準備額 3,197,900
	11月12日以降の残り所要
	積数 500
	平均 100

国庫短期証券入札予定

11月15日	3ヶ月	第870回
11月19日	1年	
11月22日	3ヶ月	
11月29日	3ヶ月	
国債入札予定		
11月12日	30年	
11月14日	5年	
11月20日	20年	
11月26日	40年	

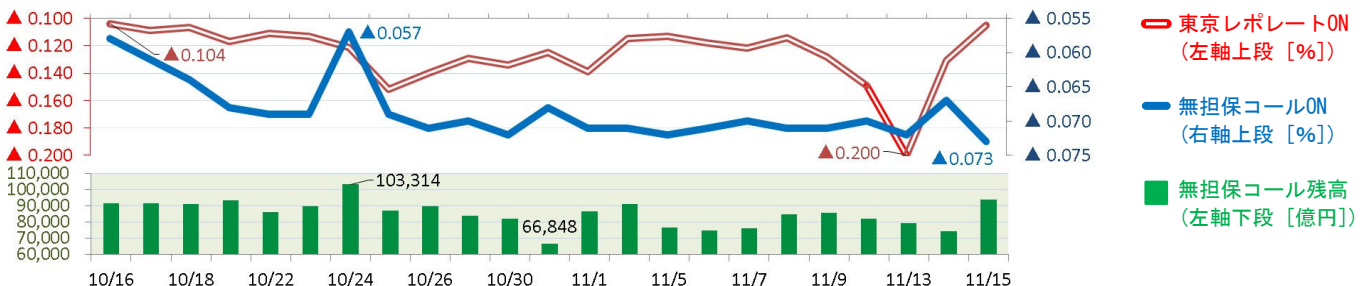
今月の国債買入オペ予定

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	100~1,000 程度	500	月2回程度	11月11日	1
1年超3年以下	3,000~5,500 程度	4,200			
3年超5年以下	2,000~4,500 程度	3,400	5 11 19 25	11月11日	2
5年超10年以下	2,000~5,000 程度	3,500	1 11 19 27	11月11日	2
10年超25年以下	500~2,000 程度	1,000			
25年超	0~500 程度	300	5 15 25	11月5日	2
物価連動債	300 程度	300	月2回程度	11月1日	1
変動利付債<偶数月>	1,000 程度	1,000	-	10月15日	-

1年前の市場推移

○2018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。