

短期市場の推移

	11月6日	11月7日	11月8日	11月11日
加重平均金利	▲0.031	▲0.038	▲0.050	▲0.065
東京レポレート(ON)	▲0.102	▲0.103	▲0.104	▲0.164
無コール残	79,599	87,464	87,485	76,293
ON	56,604	63,944	54,545	42,103
その他	22,995	23,520	32,940	34,190
有コール残	18,331	18,756	18,392	15,025

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
8:50 10月国内企業物価指数 [前年比]	▲0.2%	19:00 (欧)9月鉱工業生産指数 [前月比]	-0.3%
16:30 フェイルの発生状況 (10月)	-	21:00 (米)MBA住宅ローン申請 指数[前週比]	-
		22:30 (米)10月消費者物価コア 指数[前年比]	2.4%

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	▲0.070	▲0.211
T/N	-	-	-	▲0.262
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	▲0.060	▲0.217
2W	▲0.040	▲0.005	▲0.033	▲0.158
3W	-	-	▲0.040	▲0.140
1M	-	-	0.010	▲0.134
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.141
6M	-	-	-	▲0.170
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▲0.075%の出合から始まり、その後は主に▲0.087%~▲0.070%の水準で取引された。前営業日に引き続き、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▲0.005%の▲0.070%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.087 ~ ▲0.087	▲0.085 ~ ▲0.085	▲0.087 ~ ▲0.055

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12日	11月13日	11月13日	11月14日	11月14日	11月15日
券	+700	+700	+700	▲1,000	▲1,000	▲1,000
財政	▲1,000	▲6,500	▲6,500	▲1,000	▲1,000	▲1,000
過不足	▲300	▲5,800	▲5,800	▲2,000	▲2,000	▲2,000
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
国庫短期証券買入		+11,800		+1,000		
国債買入						
CP等買入	▲100		▲100			
国債補完供給	+100					
当座預金増減	+11,500	▲4,900	▲4,900	▲2,000	▲2,000	▲2,000
当座預金残高	4,058,000	4,053,100	4,053,100	4,051,100	4,051,100	4,051,100
準備預金残高	3,496,900					
積み終了先	3,496,600					
超過準備	3,496,600					
非準備預金残高	561,100					
準備預金進捗率	99.9%		源泉税揚げ			
平均	90.3%		国債発行(30年)			
乖離率	9.6%					

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
国庫短期証券買入(11/13~)	1,000	6,820	1,001	0.012	0.013	97.1
国債補完供給(11/12~11/13)			22	22	▲0.450	▲0.450

マナタリーベース [億円]
11月11日時点 5,168,200

所要 [億円]
今積期の所要準備額 3,197,900
11月13日以降の残り所要
積数 200
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	第871回
11月22日	3ヶ月	
11月29日	3ヶ月	
11月14日	5年	
11月20日	20年	
11月26日	40年	
11月28日	2年	

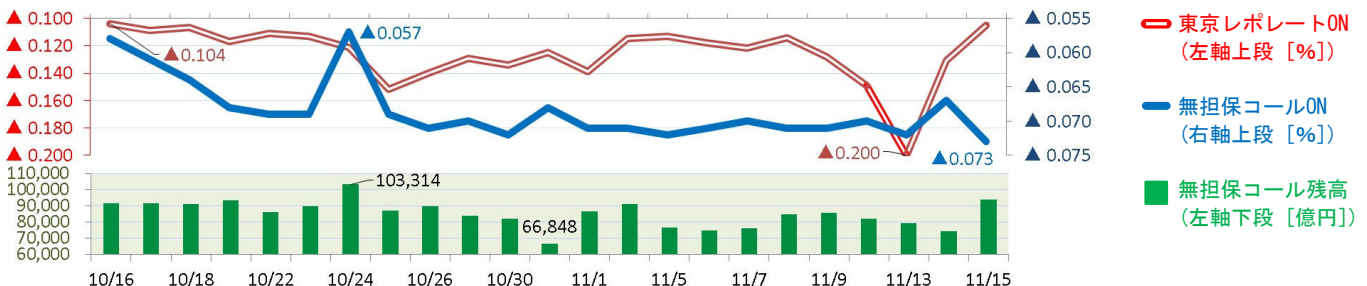
今月の国債買入オペ予定

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。