

短期市場の推移

	11月8日	11月11日	11月12日	11月13日
加重平均金利	▲0.050	▲0.065	▲0.070	▲0.072
東京レポレート(ON)	▲0.104	▲0.164	▲0.211	▲0.108
無コール残	87,485	76,293	70,128	78,985
ON	54,545	42,103	44,358	52,965
その他	32,940	34,190	25,770	26,020
有コール残	18,392	15,025	14,844	16,002

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15日の予定(時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
8:50	9月鉱工業生産・確報 (経済産業省)	22:30	(米)11月NY連銀製造業 景気指数 6.0
-	-	23:15	(米)10月鉱工業生産指数 [前月比] -0.3%
-	-	-	(欧)10月消費者物価 (確報)

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	▲0.074	▲0.086
T/N	-	-	▲0.060	▲0.113
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.040	0.000	▲0.033	▲0.107
2W	▲0.040	▲0.030	▲0.034	▲0.108
3W	-	-	-	▲0.111
1M	-	-	▲0.015	▲0.112
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.131
6M	-	-	-	▲0.170
1Y	-	-	-	▲0.188

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▲0.080%の出合から始まり、その後は主に▲0.087%~▲0.060%の水準で取引された。一巡後はオファービッドともに閑散な状況となり、同加重平均金利(速報)は前日対比▲0.002%の▲0.074%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.087 ~ ▲0.085	▲0.085 ~ ▲0.050	▲0.087 ~ ▲0.060

翌営業日のマーケット

出合水準の中心は▲0.085%~▲0.060%になると予想。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	11月14日		11月15日		11月18日	
券	▲600		+100		+0	
財政	+400		▲6,600		▲1,000	
過不足	▲200		▲6,500		▲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)	▲100					
CP等買入	▲100		▲900			
国債補完供給	+200					
当座預金増減	▲200		▲7,400		▲1,000	
当座預金残高	4,049,600		4,042,200		4,041,200	
準備預金残高	3,534,200		3,534,200		3,534,200	
積み終了先	3,534,200		3,534,200		3,534,200	
超過準備	3,534,100		3,534,100		3,534,100	
非準備先残高	515,400		515,400		515,400	
準備預金進捗率	100.0%		100.0%		100.0%	
平均	96.8%		96.8%		96.8%	
乖離率	3.2%		3.2%		3.2%	

11月14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(11/14~11/15)	19	19	▲0.350	▲0.350		

マナタリーベース [億円]
11月13日時点 5,170,200

所要 [億円]
今積期の所要準備額 3,197,900
11月15日以降の残り所要積数 0
平均 0

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20日	20年	
11月26日	40年	
11月28日	2年	
12月3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	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
物価運動債	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。