

短期市場の推移

	11月13日	11月14日	11月15日	11月18日
加重平均金利	▲0.072	▲0.074	▲0.063	▲0.058
東京レポレート(ON)	▲0.108	▲0.086	▲0.075	▲0.081
無コール残	78,985	85,356	82,845	74,414
ON	52,965	59,051	59,280	50,594
その他	26,020	26,305	23,565	23,820
有コール残	16,002	22,178	21,777	21,796

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
8:50	10月貿易収支	2831億円	22:00	(米)MBA住宅ローン申請指数[前週比]
14:00頃	実質輸出入の動向	-	-	-
	-	-	-	-

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	▲0.085	0.030	▲0.054	▲0.079
T/N	-	-	0.030	▲0.078
S/N	-	-	0.001	-
1W	▲0.040	0.000	▲0.027	▲0.080
2W	-	-	▲0.020	▲0.081
3W	0.000	0.001	0.001	▲0.085
1M	-	-	-	▲0.091
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.124
6M	-	-	-	▲0.168
1Y	-	-	-	▲0.187

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▲0.08%の出合から始まった。その後は主に▲0.080%~▲0.045%の水準で取引された。前営業日に比べビッドサイドの調達ニーズが高まったことで出合水準は上昇し、同加重平均金利(速報)は前日対比+0.004%の▲0.054%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.080 ~ ▲0.075	▲0.070 ~ ▲0.070	▲0.055 ~ ▲0.040

翌営業日のマーケット

出合の水準は▲0.065%~▲0.04%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19日	11月20日	11月20日	11月21日	11月21日	11月22日
券		+200	▲500	▲1,000		
財政		▲5,600	+5,000	▲12,000		
過不足		▲5,400	+4,500	▲13,000		
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				+11,300		
CP等買入	▲100		▲100			
国債補完供給	+300	▲900	+900			
当座預金増減		▲6,100	+16,600	▲13,000		
当座預金残高		4,036,500	4,053,100	4,040,100		
準備預金残高		3,521,500	主な需給要因			
積み終了先		3,514,800				
超過準備		3,502,000	国庫短期証券			
非準預先残高		515,000	発行・償還(1Y)			
準備預金進捗率		99.2%	国債償還			
平均		13.3%	(変動15年)			
乖離率		85.8%				

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
国債買入(11/20~)						
1~3年	4,200	8,512	4,202	▲0.004	▲0.001	54.8
3~5年	3,400	11,272	3,407	▲0.009	▲0.008	93.3
5~10年	3,500	10,489	3,510	▲0.008	▲0.007	50.6
米ドル資金供給(11/21~11/29)						
			0	0	2.070	2.070
CP等買入(11/22~)						
	4,000	7,135	3,990	▲0.002	0.001	56.6
国債補完供給(11/19~11/20)						
		864	864	▲0.350	▲0.350	

マナタリーベース [億円]	所要 [億円]
11月18日時点 5,162,800	今積期の所要準備額 3,107,700
	11月20日以降の残り所要積数 26,300
	平均 1,000

国庫短期証券入札予定

11月22日	3ヶ月	第872回
11月29日	3ヶ月	
12月6日	3ヶ月	
12月9日	6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	

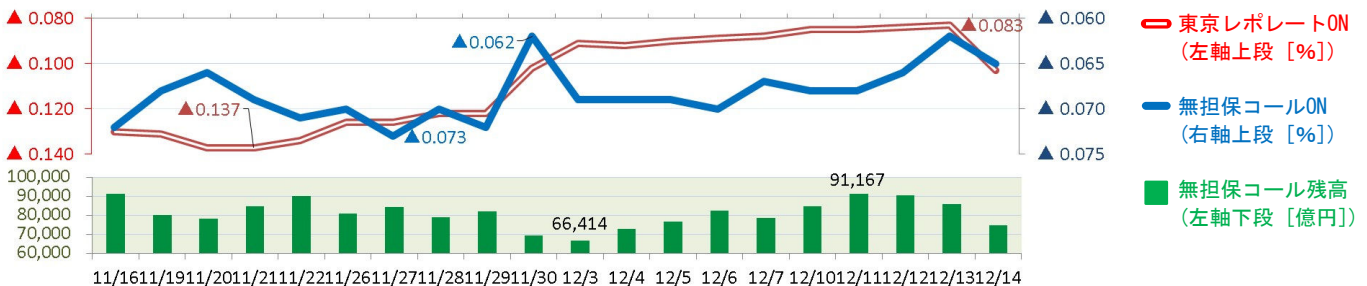
今月の国債買入オペ予定

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19日	1
5年超10年以下	2,000~5,000 程度	3,500	1 11 19 27	11月19日	1
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15日	1
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11月積み期 [11月16日~12月14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。