

短期市場の推移

	11月15日	11月18日	11月19日	11月20日
加重平均金利	▲0.063	▲0.058	▲0.054	▲0.047
東京レポレート(ON)	▲0.075	▲0.081	▲0.079	▲0.081
無コール残	82,845	74,414	78,902	83,889
ON	59,280	50,594	55,277	61,564
その他	23,565	23,820	23,625	22,325
有コール残	21,777	21,796	20,449	19,633

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22日の予定(時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
8:30	10月消費者物価コア指数 [前年比]	+0.4%	16:00 (独)7-9月期国内総生産 (GDP)[前年比]
10:00	営業毎旬報告 (11月20日現在)	-	23:45 (米)11月製造業PMI
			(欧)カナル ECB総裁講演

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	▲0.065	0.001	▲0.039	▲0.083
T/N	-	-	-	▲0.090
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.025	0.000	▲0.019	▲0.090
2W	-	-	▲0.005	▲0.092
3W	-	-	▲0.005	▲0.094
1M	▲0.015	0.010	▲0.014	▲0.099
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.129
6M	-	-	-	▲0.169
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▲0.050%の出合から始まった。その後は主に▲0.060%~▲0.030%の水準で取引された。昨日に引き続きビットサイドの調達ニーズが強く、加重平均金利は前日対比+0.008の▲0.039%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.060 ~ ▲0.055	▲0.040 ~ ▲0.040	▲0.050 ~ ▲0.030

翌営業日のマーケット

引き続きビットサイドの調達ニーズが強く、三日積み要因もあり、本日よりさらに堅調な地合いになると予想。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想
	11月21日	11月22日	11月22日	11月25日	11月25日
券	▲1,100	▲800	▲800	+0	
財政	▲12,500	+5,300	+5,300	▲8,000	
過不足	▲13,600	+4,500	+4,500	▲8,000	
金融調節	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド
国庫短期証券買入				+1,000	
共通担保(全店)					▲4,500
CP等買入	▲200		▲100	+4,000	
社債等買入	▲100				
国債補完供給	+100	▲200	+200		
当座預金増減	▲14,000	+9,600	+9,600	▲12,500	
当座預金残高	4,039,600	4,049,200	4,049,200	4,036,700	
準備預金残高	3,516,700				
積み終了先	3,514,300				
超過準備	3,513,100				
非準備預金残高	522,900				
準備預金進捗率	99.5%				
平均	20.0%				
乖離率	79.5%				

11月21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
国庫短期証券買入(11/22~)	1,000	7,027	1,001	0.002	0.002	93.6
国債補完供給(11/21~11/22)			216	216	▲0.350	▲0.350

マナタリーベース [億円]
11月20日時点 5,174,200

所要 [億円]
今積期の所要準備額 3,107,700
11月22日以降の残り所要積数 17,000
平均 700

国庫短期証券入札予定

11月22日	3ヶ月	第8/2回
11月29日	3ヶ月	
12月6日	3ヶ月	
12月9日	6ヶ月	
11月26日	40年	
11月28日	2年	
12月3日	10年	
12月5日	30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。