

短期市場の推移

	11月18日	11月19日	11月20日	11月21日
加重平均金利	▲0.058	▲0.054	▲0.047	▲0.039
東京レポレート(ON)	▲0.081	▲0.079	▲0.081	▲0.083
無コール残	74,414	78,902	83,889	77,948
ON	50,594	55,277	61,564	49,173
その他	23,820	23,625	22,325	28,775
有コール残	21,796	20,449	19,633	19,781

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25日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	18:00 (独)11月IFO企業景況感指数	-
-	-	(米)パウエルFRB議長講演	-
-	-	-	-

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	▲0.060	0.001	▲0.030	▲0.078
T/N	-	-	-	▲0.078
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.023	▲0.015	▲0.021	▲0.081
2W	▲0.025	▲0.010	▲0.020	▲0.083
3W	-	-	0.001	▲0.090
1M	-	-	▲0.001	▲0.095
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▲0.035%の出合から始まった。その後は主に▲0.035%~▲0.020%の水準で取引された。3日積みのため、日銀当座預金の基礎残高・マクロ加算残高の調整を目的とした調達ニーズが高まった結果、加重平均金利は前日対比+0.009の▲0.030%(速報)となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.035 ~ ▲0.035	▲0.030 ~ ▲0.030	▲0.035 ~ ▲0.020

翌営業日のマーケット

ビッドサイドの調達ニーズが強く、本日と同様に堅調な地合いを予想。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	11月22日	11月25日	11月25日	11月26日	11月26日	11月26日
券	▲900	+300	+300	+0	+0	+0
財政	+3,100	▲4,900	▲4,900	▲1,000	▲1,000	▲1,000
過不足	+2,200	▲4,600	▲4,600	▲1,000	▲1,000	▲1,000
金融調節	エンド	スタート	エンド	スタート	スタート	スタート
国庫短期証券買入		+1,000				
共通担保(全店)			▲4,500	+6,200		
CP等買入	▲100	+4,000	▲400			
社債等買入			▲400			
国債補完供給	+200	▲900	+900			
当座預金増減	+6,400	▲2,800	▲2,800	▲1,000	▲1,000	▲1,000
当座預金残高	4,046,000	4,043,200	4,043,200	4,042,200	4,042,200	4,042,200
準備預金残高	3,528,800					
積み終了先	3,527,300					
超過準備	3,526,800					
非準備預金残高	517,200					
準備預金進捗率	99.6%					
平均	30.0%					
乖離率	69.6%					

11月22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(11/22~11/25)	819	819	▲0.350	▲0.350		
共通担保(全店)(11/25~12/9)	15,000	6,216	6,216			

マナタリーベース [億円]
11月21日時点 5,161,400

所要 [億円]
今積期の所要準備額 3,107,700
11月25日以降の残り所要積数 11,000
平均 500

国庫短期証券入札予定

11月29日	3ヶ月	第8/3回
12月6日	3ヶ月	
12月9日	6ヶ月	
12月13日	3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。