

短期市場の推移

[億円] [%]

	11月19日	11月20日	11月21日	11月22日
加重平均金利	▲0.054	▲0.047	▲0.039	▲0.030
東京レポレート(ON)	▲0.079	▲0.081	▲0.083	▲0.078
無コール残	78,902	83,889	77,948	81,601
ON	55,277	61,564	49,173	50,876
その他	23,625	22,325	28,775	30,725
有コール残	20,449	19,633	19,781	19,990

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。

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	▲0.027	▲0.079
T/N	0.001	0.030	0.017	▲0.075
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.030	▲0.020	▲0.023	▲0.079
2W	-	-	-	▲0.081
3W	-	-	-	▲0.087
1M	-	-	-	▲0.094
2M	-	-	-	-
3M	▲0.027	▲0.025	▲0.027	▲0.128
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

11月26日の予定(時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
8:50	企業向けサービス価格指数(10月)	-	22:30	(米)卸売在庫
14:00	基調的なインフレ率を捕捉するための指標	-	23:00	(米)9月S&P/コアロジックCS20都市住宅価格指数[前年比]
	-	-	-	-

経済指標及び予想値は株式会社フィスコ提供

本日の市況

本日の無担保コールON物は▲0.025%の出合から始まった。その後は主に▲0.030%~▲0.020%の水準で取引された。先週に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+0.003%の▲0.027%(速報)となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.030 ~ ▲0.030	▲0.025 ~ ▲0.025	▲0.030 ~ ▲0.020

翌営業日のマーケット

出合の水準は▲0.035%~▲0.015%になると予想。

資金需給

[億円]

	日銀速報	日銀予想	当社需給予想
	11月25日	11月26日	11月27日
券	+100	▲400	+0
財政	▲4,600	+1,100	▲4,000
過不足	▲4,500	+700	▲4,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国債買入	▲4,500	+6,200	▲100
共通担保(全店)	▲400		
CP等買入	▲400		
社債等買入	+900		
国債補完供給			
当座預金増減	▲2,700	+9,900	▲4,000
当座預金残高	4,043,300	4,053,200	4,049,200
準備預金残高	3,524,400	主な需給要因	
積み終了先	3,523,200	国債発行(40年)	
超過準備	3,523,100		
非準備先残高	518,900		
準備預金進捗率	99.7%		
平均	33.3%		
乖離率	66.4%		

11月25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	按分
国債買入(11/26~)						
1~3年	4,200	10,572	4,207	▲0.005	▲0.004	70.4
3~5年	3,400	6,730	3,403	▲0.012	▲0.009	16.6
10~25年	1,000	3,599	1,004	0.000	0.002	41.7
25年~	300	1,041	300	0.011	0.014	54.0
社債等買入(11/29~)						
	1,000	3,014	1,000	0.021	0.026	65.0
国債補完供給(11/25~11/26)						
	1	1	▲0.350	▲0.350		

マネタリーベース [億円]
11月22日時点 5,168,700

所要 [億円]
今積期の所要準備額 3,107,700
11月26日以降の残り所要
積数 9,700
平均 500

国庫短期証券入札予定

11月29日 3ヶ月	第873回
12月6日 3ヶ月	
12月9日 6ヶ月	
12月13日 3ヶ月	
国債入札予定	
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25日	0
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25日	0
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。