

短期市場の推移

	11月20日	11月21日	11月22日	11月25日
加重平均金利	▲0.047	▲0.039	▲0.030	▲0.027
東京レポレート(ON)	▲0.081	▲0.083	▲0.078	▲0.079
無コール残	83,889	77,948	81,601	69,492
ON	61,564	49,173	50,876	42,877
その他	22,325	28,775	30,725	26,615
有コール残	19,633	19,781	19,990	20,146

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27日の予定(時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
10:30	【挨拶】 櫻井審議委員(兵庫)	22:30	(米)7-9月期国内総生産(GDP)改定値[前期比年率] 1.9%
	-	22:30	(米)10月耐久財受注[前月比] -0.7%
	-	22:30	(米)新規失業保険申請件数[前週分] -

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	▲0.070	0.030	▲0.018	▲0.081
T/N	-	-	-	▲0.076
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.023	▲0.020	▲0.021	▲0.078
2W	-	-	▲0.018	▲0.080
3W	-	-	-	▲0.087
1M	-	-	▲0.020	▲0.096
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▲0.025%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。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強い調達ニーズに、試取りの動きが加わり、加重平均金利は前日対比+0.009%の▲0.018%(速報)となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.030 ~ ▲0.025	▲0.025 ~ ▲0.025	▲0.030 ~ ▲0.015

翌営業日のマーケット

引き続き強い調達ニーズを背景に、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26日	11月27日	11月27日	11月28日	11月28日
券	▲500	▲600	▲600	▲1,000	▲1,000
財政	▲200	▲6,900	▲6,900	▲2,000	▲2,000
過不足	▲700	▲7,500	▲7,500	▲3,000	▲3,000
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	
国債買入		+9,300			
CP等買入	▲100		▲200		
国債補完供給		▲300	+300		
当座預金増減	+8,200	▲6,400	▲6,400	▲3,000	▲3,000
当座預金残高	4,051,500	4,045,100	4,045,100	4,042,100	4,042,100
準備預金残高	3,510,800				
積み終了先	3,509,500				
超過準備	3,509,500				
非準備先残高	540,700				
準備預金進捗率	99.7%				
平均	36.7%				
乖離率	63.1%				

11月26日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	接分
国庫短期証券買入(11/27~)	1,000	9,158	1,000	0.055	0.055	
米ドル資金供給(11/29~12/5)	0	0	2,080	2,080		
国債補完供給(11/26~11/27)	286	286	▲0.350	▲0.350		

マネタリーベース [億円]
 11月25日時点 5,166,000

所要 [億円]
 今積期の所要準備額 3,107,700
 11月27日以降の残り所要積数 8,500
 平均 400

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28日	2年	
12月3日	10年	
12月5日	30年	
12月10日	5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。