

短期市場の推移

	11月25日	11月26日	11月27日	11月28日
加重平均金利	▲0.027	▲0.018	▲0.023	▲0.024
東京レポレート(ON)	▲0.079	▲0.081	▲0.075	▲0.078
無コール残	69,492	90,662	76,469	77,628
ON	42,877	62,647	49,954	51,173
その他	26,615	28,015	26,515	26,455
有コール残	20,146	19,622	20,282	20,609

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。

12月2日の予定(時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	(米)ISM製造業指数(11月)	-
-	-	(欧)カール・ ECB総裁 議会証言	-
-	-	-	-

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	▲0.080	0.001	▲0.034	▲0.071
T/N	-	-	-	▲0.064
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.025	▲0.010	▲0.017	▲0.067
2W	-	-	▲0.040	▲0.068
3W	-	-	-	▲0.077
1M	-	-	-	▲0.116
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.120
6M	-	-	-	▲0.167
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▲0.040%の出合から始まった。その後は▲0.040%～▲0.025%の水準で取引された。月末で調達を控える先もあったため、地合いは昨日より弱含む展開となり、同加重平均金利は前日対比▲0.010%の▲0.034%(速報)となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.040 ~ ▲0.040	▲0.035 ~ ▲0.030	▲0.035 ~ ▲0.025

翌営業日のマーケット

月末要因が剥落するものの、地合いに大きな変化はなく横ばい圏での推移を予想。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	11月29日		12月2日		12月3日	
券	▲1,200		+0		▲1,000	
財政	+1,300		▲30,100		+3,000	
過不足	+100		▲30,100		+2,000	
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
CP等買入	▲800		▲100		-	
社債等買入	+1,000		-		-	
国債補完供給	+300	▲500	+500	-	-	-
当座預金増減	+100		▲29,700		+2,000	
当座預金残高	4,046,600		4,016,900		4,018,900	
準備預金残高	3,525,800		-		-	
積み終了先	3,525,500		-		-	
超過準備	3,525,400		-		-	
非準備先残高	520,800		-		-	
準備預金進捗率	99.8%		-		-	
平均	53.3%		-		-	
乖離率	46.5%		-		-	

11月29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(11/29~12/2)	527	527	▲0.350	▲0.350	-	-

マナタリーベース [億円]
11月28日時点 5,172,100

所要 [億円]
今積期の所要準備額 3,111,500
12月2日以降の残り所要積数 5,400
平均 400

国庫短期証券入札予定

12月6日	3ヶ月	第8/74回
12月9日	6ヶ月	
12月13日	3ヶ月	
12月18日	1年	
12月3日	10年	
12月5日	30年	
12月10日	5年	
12月17日	20年	

来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27日	2
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	2 6 13 18	11月25日	4
5年超10年以下	2,000~5,000 程度	3,500	6 13 18 25	11月27日	4
10年超25年以下	500~1,500 程度	1,000			
25年超	0~500 程度	300	2 9 25	11月25日	3
物価連動債	300 程度	300	月2回程度	11月27日	2
変動利付債<偶数月>	1,000 程度	1,000	-	10月15日	1

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。