

短期市場の推移

[億円][%]

11月7日の予定(時刻は日本時間)

	10月31日	11月1日	11月2日	11月5日
加重平均金利	▲0.068	▲0.071	▲0.071	▲0.072
東京レポレート(ON)	▲0.125	▲0.139	▲0.115	▲0.113
無コール残	66,848	86,584	91,293	76,599
ON	34,528	54,064	56,623	42,029
その他	32,320	32,520	34,670	34,570
有コール残	11,652	14,035	17,912	16,811

	日本	予想	海外	予想
8:50	マネタリーベースと日本銀行の取引(10月)	-	0:00	(米)9月JOLT求人件数
10:30	【挨拶】布野審議委員(高知)	-	21:00	(米)MBA住宅ローン申請指数[前週比]
15:00	コール市場残高(10月)	-	-	-

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。

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	▲0.086	0.001	▲0.071	▲0.118
T/N	-	-	▲0.010	▲0.142
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.045	0.001	▲0.020	▲0.142
2W	-	-	-	▲0.142
3W	-	-	-	▲0.144
1M	-	-	-	▲0.147
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.153
6M	-	-	-	▲0.152
1Y	-	-	-	▲0.159

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

無担保コールON物は▲0.085%の出合から始まった。その後は、前日と同様に軟調な地合いとなり、主に▲0.086%~▲0.040%の水準で取引された。同加重平均金利(速報値)は前営業日対比+0.001%の▲0.071%となった。

都銀・信託		証券	地銀
▲0.086 ~ ▲0.086		- ~ -	▲0.086 ~ ▲0.055

翌営業日のマーケット

本日と同様に調達サイドが慎重な姿勢となり、軟調な地合いを予想する。

資金需給

[億円]

	日銀速報	日銀予想	当社需給予想
	11月6日	11月7日	11月8日
券	+800	+700	+1,000
財政	+1,100	▲3,500	▲1,000
過不足	+1,900	▲2,800	+0
金融調節	エンド	スタート	エンド
国庫短期証券買入			+1,000
国債買入		+3,100	
社債等買入	▲100		
国債補充供給	+400	▲100	+100
当座預金増減	+5,200	▲1,700	+0
当座預金残高	3,922,900	3,921,200	3,921,200
準備預金残高	3,439,100	主な需給要因	
積み終了先	3,438,500	10年物価連動 国債発行	
超過準備	3,438,500		
非準備預金残高	483,800		
準備預金進捗率	99.9%		
平均	71.0%		
乖離率	28.9%		

11月6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(11/7~)	1,000	9,252	1,000	0.015	0.015	
米ドル資金供給(11/8~11/16)	0	0	2,700	2,700		
国債補充供給(11/6~11/7)	69,135	71	71	▲0.600	▲0.600	
CP等買入(11/9~)	2,000	4,650	1,960	▲0.002	▲0.002	85.1

マネタリーベース [億円]	所要 [億円]
11月5日時点 5,016,700	今積期の所要準備額 3,102,700
	11月7日以降の残り所要積数 2,100
	平均 200

国庫短期証券入札予定

今月の国債買入オペ予定

11月8日	6ヶ月	第794回
11月9日	3ヶ月	第795回
11月16日	3ヶ月	
11月19日	1年	
11月13日	30年	
11月15日	5年	
11月20日	20年	
11月27日	40年	

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5日	1
1年超3年以下	2,500~4,500 程度	3,500			
3年超5年以下	3,000~5,500 程度	4,000	2	9 19 28	11月2日 3
5年超10年以下	3,000~6,000 程度	4,500	2	12 16 26 30	11月2日 4
10年超25年以下	1,500~2,500 程度	1,800	5	9 16 26 30	11月5日 4
25年超	100~1,000 程度	500			
物価連動債	250 程度	250	月2回程度	10月19日	2
変動利付債<偶数月>	1,000 程度	1,000	1回	10月17日	1

1年前の市場推移

○2017年10月積み期 [10月16日~11月15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。