

短期市場の推移

[億円] [%]

	11月2日	11月5日	11月6日	11月7日
加重平均金利	▲0.071	▲0.072	▲0.071	▲0.070
東京レポレート(ON)	▲0.115	▲0.113	▲0.118	▲0.122
無コール残	91,293	76,599	74,887	76,207
ON	56,623	42,029	42,547	42,017
その他	34,670	34,570	32,340	34,190
有コール残	17,912	16,811	14,266	14,983

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9日の予定(時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
8:50	マネーストック(10月)	-	4:00	(米)11月FOMC 政策金利発表	2.25%
-	-	-	22:30	(米)10月生産者物価 指数[前年比]	2.5%
-	-	-	-	-	-

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

本日の市況

	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	▲0.114
T/N	-	-	▲0.015	▲0.137
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	▲0.046	▲0.141
2W	-	-	-	▲0.143
3W	-	-	-	▲0.146
1M	-	-	-	▲0.149
2M	-	-	-	-
3M	-	-	▲0.045	▲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

無担保コールON物は▲0.085%の出合から始まり、主に▲0.086%~▲0.050%の水準で取引された。昨日同様、ビッドサイドの慎重な調達姿勢は変わらず、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 ~ ▲0.050

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、軟調な地合を予想する。

資金需給

[億円]

	日銀速報 11月8日	日銀予想 11月9日	当社需給予想 11月12日
券	▲200	+400	+1,000
財政	+2,300	▲4,800	▲10,000
過不足	+2,100	▲4,400	▲9,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
共通担保(全店)			
CP等買入	▲100	▲200	+2,000
ETF買入	+100	+1,000	+1,000
国債補完供給	▲100	+100	
当座預金増減	+2,000	▲1,500	▲11,100
当座預金残高	3,922,900	3,921,400	3,910,300
準備預金残高	3,442,900	主な需給要因	
積み終了先	3,442,800		
超過準備	3,442,400		
非準備預金残高	480,000	国庫短期証券 発行・償還 (3M・6M)	
準備預金進捗率	99.9%		
平均	77.4%		
乖離率	22.5%		

11月8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
国債補完供給(11/8~11/9)	41,485	58	58	▲0.600	▲0.600	

マネタリーベース [億円]
11月7日時点 5,018,400

所要 [億円]
今積期の所要準備額 3,105,100
11月9日以降の残り所要
積数 800
平均 100

国庫短期証券入札予定

今月の国債買入オペ予定

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22日	3ヶ月	
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。