

短期市場の推移

[億円] [%]

	11月12日	11月13日	11月14日	11月15日
加重平均金利	▲0.070	▲0.072	▲0.067	▲0.073
東京レポレート(ON)	▲0.149	▲0.200	▲0.131	▲0.105
無コール残	82,088	79,451	74,293	94,093
ON	46,298	45,891	42,283	61,953
その他	35,790	33,560	32,010	32,140
有コール残	15,131	11,714	16,298	29,050

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19日の予定(時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
8:50	10月貿易収支	-688億円	18:00	(欧)9月経常収支
14:00頃	実質輸出入の動向	-		(米)NY連銀総裁の講演

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	▲0.072	▲0.130
T/N	-	-	▲0.015	▲0.132
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.045	0.230	▲0.033	▲0.136
2W	▲0.047	▲0.040	▲0.043	▲0.138
3W	-	-	-	▲0.141
1M	-	-	-	▲0.147
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.161
6M	-	-	-	▲0.157
1Y	-	-	-	▲0.161

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

積み初日となる本日の無担保コールON物は、▲0.086%の出合から始まった。その後は、主に▲0.086%~▲0.045%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▲0.072%となった。

都銀・信託		証券		地銀	
▲0.086	~ ▲0.086	▲0.086	~ ▲0.086	▲0.086	~ ▲0.045

翌営業日のマーケット

ビッドサイドの調達姿勢は変わらず、軟調な地合が継続すると予想する。

資金需給

[億円]

	日銀速報	日銀予想	当社需給予想
	11月16日	11月19日	11月20日
券	▲600	+200	▲1,000
財政	▲23,500	▲3,700	+1,000
過不足	▲24,100	▲3,500	+0
金融調節	エンド	スタート	エンド
国債買入			+7,100
共通担保(全店)		▲1,800	+1,500
CP等買入	▲100	+2,000	
ETF買入		+700	
国債補完供給	+4,000	▲700	+700
当座預金増減	▲18,200	+4,000	+0
当座預金残高	3,909,300	3,913,300	3,913,300
準備預金残高	3,422,400	主な需給要因	
積み終了先	3,396,500	国庫短期証券	
超過準備	2,437,800	発行・償還(1Y)	
非準備先残高	486,900	国債償還	
準備預金進捗率	98.1%	(変動15年)	
平均	10.0%		
乖離率	88.1%		

11月16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
国債買入(11/19~)						
5~10年	4,500	9,391	4,512	▲0.005	▲0.005	74.1
10~25年	1,800	4,902	1,810	▲0.007	▲0.005	7.6
25年~	500	1,384	504	▲0.008	▲0.007	78.0
国債補完供給(11/16~11/19)						
	139,488	635	635	▲0.600	▲0.600	
	10,713	72	72	▲0.600	▲0.600	
共通担保(全店)(11/19~12/3)						
	8,000	1,462	1,462			

マナタリーベース [億円]	所要 [億円]
11月15日時点 5,023,100	今積期の所要準備額 3,010,900
	11月19日以降の残り所要積数 57,100
	平均 2,100

国庫短期証券入札予定

11月19日	1年	第797回
11月22日	3ヶ月	第798回
11月30日	3ヶ月	
12月6日	6ヶ月	
国債入札予定		
11月20日	20年	
11月27日	40年	
11月29日	2年	
12月4日	10年	

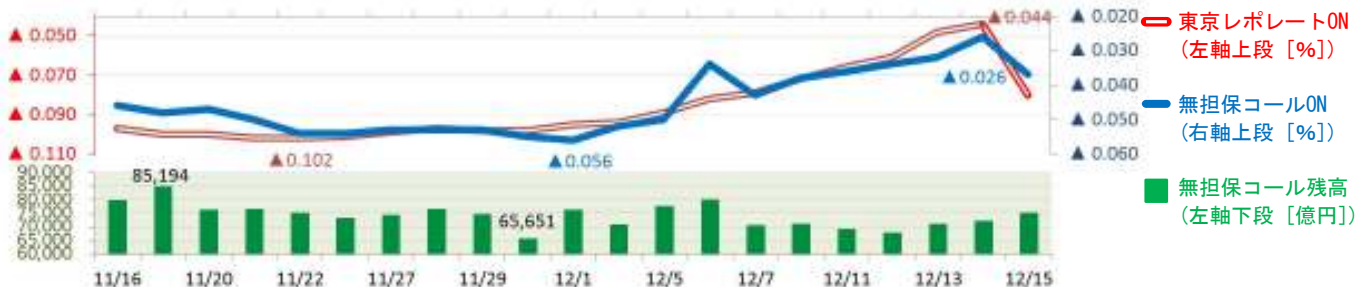
今月の国債買入オペ予定

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9日	2
5年超10年以下	3,000~6,000 程度	4,500	2 12 16 26 30	11月16日	2
10年超25年以下	1,500~2,500 程度	1,800			
25年超	100~1,000 程度	500	5 9 16 26 30	11月16日	2
物価連動債	250 程度	250	月2回程度	11月12日	1
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11月積み期 [11月16日~12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。