

短期市場の推移

	11月15日	11月16日	11月19日	11月20日
加重平均金利	▲0.073	▲0.072	▲0.068	▲0.066
東京レポレート(ON)	▲0.105	▲0.130	▲0.131	▲0.137
無コール残	94,093	91,082	79,996	77,927
ON	61,953	58,222	45,406	42,987
その他	32,140	32,860	34,590	34,940
有コール残	29,050	13,255	15,726	13,596

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22日の予定(時刻は日本時間)

時刻	日本	予想	海外	予想
8:30	10月消費者物価コア指数[前年比]	+1.0%	0:00 (米)10月景気先行指数	0.1%
10:00	営業毎旬報告(11月20日現在)	-	0:00 (米)10月中古住宅販売件数	520万件
17:00頃	日本銀行が保有する国債の銘柄別残高	-	-	-

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	▲0.069	▲0.137
T/N	-	-	▲0.015	▲0.165
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	▲0.035	▲0.167
2W	▲0.045	▲0.005	▲0.034	▲0.169
3W	-	-	-	▲0.169
1M	-	-	-	▲0.168
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.175
6M	-	-	-	▲0.161
1Y	-	-	-	▲0.163

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、▲0.086%の合出から始まった。その後は昨日と大きく変わらず、主に▲0.086%～▲0.050%の水準で取引される軟調な地合いであった。同加重平均金利(速報値)は前営業日対比▲0.003%の▲0.069%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.086 ~ ▲0.086	▲0.086 ~ ▲0.086	▲0.086 ~ ▲0.050

翌営業日のマーケット

連休を挟む翌日物となるが、調達姿勢に大きな変化はないものと予想する。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想
	11月21日	11月22日	11月22日	11月26日	11月26日
券	▲1,700	▲2,100	▲2,100	+0	+0
財政	▲13,800	+8,300	+8,300	▲7,000	▲7,000
過不足	▲15,500	+6,200	+6,200	▲7,000	▲7,000
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	▲2,200	
共通担保(全店)					
CP等買入			▲600		
社債等買入			▲200		
国債補完供給	+300	▲200	+200		
当座預金増減	▲15,400	+6,600	+6,600	▲9,200	▲9,200
当座預金残高	3,905,000	3,911,600	3,911,600	3,902,400	3,902,400
準備預金残高	3,411,000	主な需給要因			
積み終了先	3,403,900				
超過準備	3,403,900				
非準備預金残高	494,000				
準備預金進捗率	99.4%	国庫短期証券発行・償還(3M)			
平均	20.0%				
乖離率	79.4%				

11月21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(11/22~)	1,000	7,493	1,000	0.027	0.031	44.4
国債補完供給(11/21~11/22)	64,260	173	173	▲0.600	▲0.600	

マナタリーベース [億円]
11月20日時点 5,017,600

所要 [億円]
今積期の所要準備額 3,010,900
11月22日以降の残り所要積数 17,900
平均 700

国庫短期証券入札予定

11月22日	3ヶ月	第798回
11月30日	3ヶ月	
12月6日	6ヶ月	
12月7日	3ヶ月	
11月27日	40年	
11月29日	2年	
12月4日	10年	
12月11日	30年	

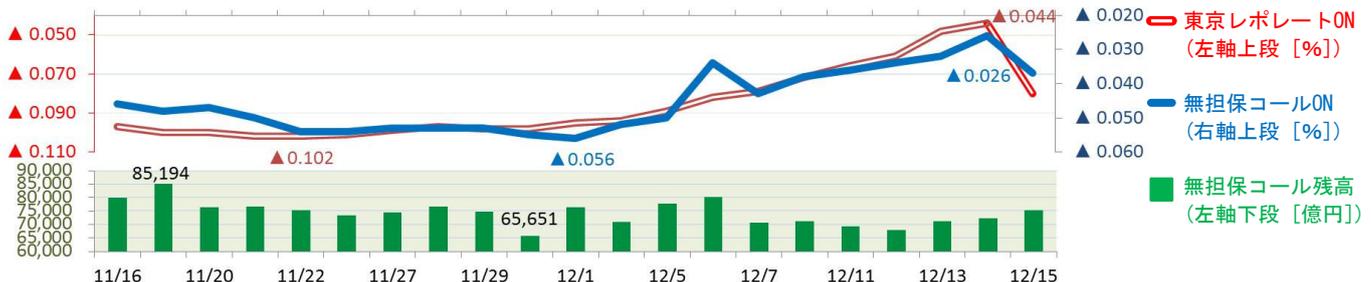
今月の国債買入オペ予定

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19日	0
1年超3年以下	2,500~4,500 程度	3,500	28	11月19日	1
3年超5年以下	3,000~5,500 程度	4,000	28	11月19日	1
5年超10年以下	3,000~6,000 程度	4,500	26 30	11月16日	2
10年超25年以下	1,500~2,500 程度	1,800	26 30	11月16日	2
25年超	100~1,000 程度	500	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。