

短期市場の推移

[億円] [%]

	11月19日	11月20日	11月21日	11月22日
加重平均金利	▲0.068	▲0.066	▲0.069	▲0.071
東京レポレート(ON)	▲0.131	▲0.137	▲0.137	▲0.134
無コール残	79,996	77,927	84,506	89,992
ON	45,406	42,987	49,596	55,902
その他	34,590	34,940	34,910	34,090
有コール残	15,726	13,596	14,191	13,207

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27日の予定(時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
8:50 企業向けサービス価格指数(10月)	-	23:00 (米)9月S&PコアブティックCS20都市住宅価格指数[前年比]	-
-	-	(米)9月のFHFA住宅価格指数	-
-	-	(米)11月の消費者信頼感指数	-

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 ▲0.070	▲0.126
T/N	- - -	▲0.162
S/N	- - -	-
1W	▲0.048 ▲0.015 ▲0.039	▲0.176
2W	- - -	▲0.175
3W	- - -	▲0.174
1M	- - -	▲0.173
2M	- - -	-
3M	- - -	▲0.176
6M	- - -	▲0.163
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%の出合から始まった。ビッドサイドの調達姿勢に大きな変化はなく、その後は主に▲0.086%~▲0.050%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▲0.070%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

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26日	11月27日	11月28日
券	▲200	▲400	▲1,000
財政	▲11,200	+1,200	▲4,000
過不足	▲11,400	+800	▲5,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国債買入		+7,200	スタート
共通担保(全店)	▲2,200	+2,600	
CP等買入	▲100	▲200	
社債等買入	▲100	+800	
ETF買入	+1,200	+300	
国債補完供給	▲200	+200	
当座預金増減	▲10,200	+9,100	▲5,000
当座預金残高	3,902,000	3,911,100	3,906,100
準備預金残高	3,404,900	主な需給要因	
積み終了先	3,403,500	国債発行(40年)	
超過準備	3,403,500		
非準備先残高	497,100		
準備預金進捗率	99.8%		
平均	36.7%		
乖離率	63.1%		

11月26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	按分
国債買入(11/27~)						
5~10年	4,500	10,151	4,506	▲0.003	▲0.002	67.0
10~25年	1,800	6,742	1,811	▲0.001	0.001	4.9
25年~	500	1,948	503	0.003	0.003	90.4
国債補完供給(11/26~11/27)						
	51,680	234	234	▲0.600	▲0.600	

マネタリーベース [億円]
11月22日時点 5,013,100

所要 [億円]
今積期の所要準備額 3,011,000
11月27日以降の残高所要
積数 5,900
平均 300

国庫短期証券入札予定

11月30日 3ヶ月 第799回
12月6日 6ヶ月
12月7日 3ヶ月
12月14日 3ヶ月
国債入札予定
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			
3年超5年以下	3,000~5,500 程度	4,000	2 9 19 28	11月19日	1
5年超10年以下	3,000~6,000 程度	4,500	2 12 16 26 30	11月26日	1
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26日	1
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。