

短期市場の推移

	11月26日	11月27日	11月28日	11月29日
加重平均金利	▲0.070	▲0.073	▲0.070	▲0.072
東京レポレート(ON)	▲0.126	▲0.126	▲0.122	▲0.122
無コール残	80,786	84,394	78,868	81,763
ON	47,796	52,404	47,078	49,033
その他	32,990	31,990	31,790	32,730
有コール残	20,739	15,422	18,016	19,597

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。

12月3日の予定(時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
16:00 債券市場サーベイ(2018年11月調査)	-	(米)11月のISM製造業指数	-
-	-	ダラス連銀総裁の講演	-
-	-	-	-

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	▲0.062	▲0.102
T/N	-	-	▲0.015	▲0.114
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	▲0.013	▲0.119
2W	▲0.040	▲0.035	▲0.036	▲0.122
3W	-	-	-	▲0.134
1M	-	-	-	▲0.169
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.161
6M	-	-	-	▲0.160
1Y	-	-	-	▲0.160

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ものの、月末日にあたることから資金調達を控える先が多く、▲0.086%のオファーが出し残る展開となった。前営業日より▲0.08%台のビッドが薄く、その水準の取引量が減少したことから、同加重平均金利は前営業日対比+0.010%の▲0.062%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大きく変わらず、軟調な地合が継続すると予想する。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	11月30日	12月3日	12月3日	12月4日	12月4日	12月4日
券	▲500	▲400	▲400	▲1,000	▲1,000	▲1,000
財政	+3,900	▲41,700	▲41,700	▲75,000	▲75,000	▲75,000
過不足	+3,400	▲42,100	▲42,100	▲76,000	▲76,000	▲76,000
金融調節	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド	スタート
国債買入	-	-	+7,200	-	-	-
共通担保(全店)	-	-	▲1,500	+1,900	-	-
CP等買入	▲1,100	+2,000	▲100	-	-	-
ETF買入	-	+400	-	-	-	-
国債補完供給	+1,100	▲2,600	+2,600	-	-	-
成長基盤強化支援	-	-	▲6,900	+4,100	-	-
	-	-	-	-	▲200	-
当座預金増減	+3,200	▲34,800	▲34,800	▲76,200	▲76,200	▲76,200
当座預金残高	3,912,900	3,878,100	3,878,100	3,801,900	3,801,900	3,801,900
準備預金残高	3,425,100	-	-	-	-	-
積み終了先	3,424,700	-	-	-	-	-
超過準備	3,424,700	-	-	-	-	-
非準預先残高	487,800	-	-	-	-	-
準備預金進捗率	99.9%	-	-	-	-	-
平均	56.7%	-	-	-	-	-
乖離率	43.2%	-	-	-	-	-

11月30日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	接分
国債買入(12/3~)						
5~10年	4,500	8,051	4,512	0.000	0.001	52.5
10~25年	1,800	5,179	1,815	0.001	0.002	66.1
25年~	500	1,838	506	▲0.003	▲0.002	14.6
国債補完供給(11/30~12/3)						
共通担保(全店)	169,040	987	987	▲0.600	▲0.600	
CP等買入	239,053	1,393	1,393	▲0.600	▲0.600	
共通担保(全店)(12/3~12/17)	8,000	1,855	1,855	-	-	

国庫短期証券入札予定

12月6日	6ヶ月	第800回
12月7日	3ヶ月	第801回
12月14日	3ヶ月	
12月19日	1年	
12月4日	10年	
12月11日	30年	
12月13日	5年	
12月18日	20年	

来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	2
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	3 10 17 25	11月28日	3
5年超10年以下	3,000~6,000 程度	4,500	5 10 14 19 27	11月30日	4
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 14 25 27	11月30日	5
物価連動債	250 程度	250	月2回程度	11月28日	2
変動利付債<偶数月>	1,000 程度	1,000	1回	10月17日	1

マナタリーベース

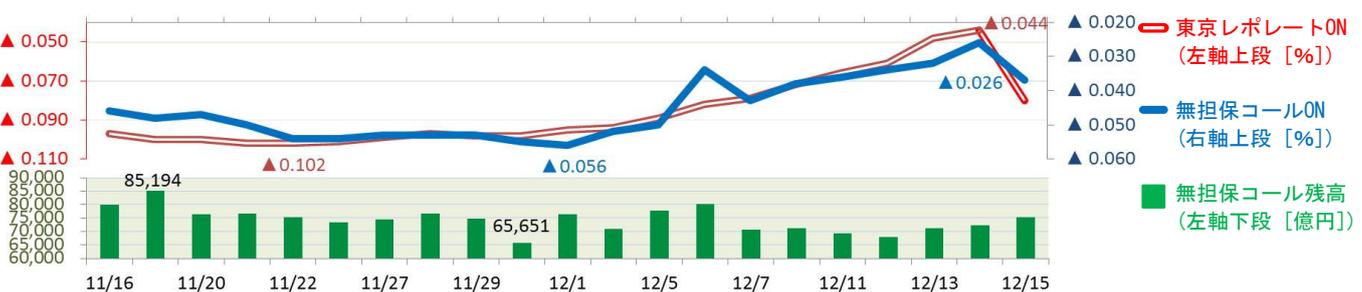
11月29日時点 5,013,000

所要

今積期の所要準備額 3,008,500
 12月3日以降の残り所要積数 2,300
 平均 200

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。