

短期市場の推移

[億円][%]

11月12日の予定(時刻は日本時間)

	11月5日	11月6日	11月7日	11月8日
加重平均金利	▲0.072	▲0.071	▲0.070	▲0.071
東京レポレート(ON)	▲0.113	▲0.118	▲0.122	▲0.114
無コール残	76,599	74,887	76,207	84,738
ON	42,029	42,547	42,017	43,118
その他	34,570	32,340	34,190	41,620
有コール残	16,811	14,266	14,983	20,062

	日本	予想	海外	予想
8:50	10月国内企業物価指数 [前年比]	+2.8%	米国休日 (ベテランズデー)	-
8:50	企業物価指数(10月)	-	サンフランシスコ 連銀総裁講演	-

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。

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	▲0.071	▲0.128
T/N	-	-	▲0.015	▲0.140
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.040	0.001	▲0.033	▲0.140
2W	-	-	▲0.045	▲0.144
3W	-	-	-	▲0.147
1M	-	-	-	▲0.149
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲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

本日の市況

無担保コールON物は▲0.086%の出合から始まり、主に▲0.086%~▲0.055%の水準で取引された。本日は今積期最後の週末3日積みであったが、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)は前営業日対比横ばいの▲0.071%となった。

	都銀・信託	証券	地銀
	▲0.086 ~ ▲0.086	▲0.086 ~ ▲0.086	▲0.086 ~ ▲0.055

翌営業日のマーケット

週明けも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9日	11月12日	11月12日	11月13日	11月13日	11月13日
券		+600	+900	+1,000	+1,000	
財政		▲6,700	▲10,200	▲1,000	▲1,000	
過不足		▲6,100	▲9,300	+0	+0	
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				+10,000		
共通担保(全店)	▲200	+2,000	▲2,100	+2,200		
CP等買入		+1,000				
ETF買入				+300		
国債補完供給	+100					
当座預金増減		▲3,200	+900	+0	+0	
当座預金残高		3,919,700	3,920,600	3,920,600	3,920,600	
準備預金残高		3,437,000				
積み終了先		3,436,900				
超過準備		3,436,900				
非準備預金残高		482,700				
準備預金進捗率		99.9%				
平均		87.1%				
乖離率		12.8%				

11月9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(11/12~)						
1~3年	3,500	10,401	3,503	▲0.003	▲0.002	74.1
3~5年	4,000	11,149	4,006	0.000	0.000	82.7
10~25年	1,800	4,641	1,814	0.001	0.002	27.9
25年~	500	1,669	505	0.002	0.002	72.5
国債補完供給(11/9~11/12)						
	32,936	10	10	▲0.600	▲0.600	
共通担保(全店)(11/12~11/26)						
	8,000	2,152	2,152			

国庫短期証券入札予定

今月の国債買入オペ予定

11月16日	3ヶ月	第796回
11月19日	1年	
11月22日	3ヶ月	
11月30日	3ヶ月	
国債入札予定		
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2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 9 16 26 30	11月9日	3
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

マナタリーベース [億円]
11月8日時点 5,020,600

所要 [億円]
今積期の所要準備額 3,105,100
11月12日以降の残り所要
積数 500
平均 100

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。