DAILY SIGNAL

上田八木短資株式会社
TEL:0120-327-017

2020年11月18日(水)

短期市場の推移 [億円][%]

	11月12日	11月13日	11月16日	11月17日
加重平均金利	▲0.034	▲0.030	▲0.038	▲0.033
東京レポレート(ON)	▲0.086	▲0.088	▲0.084	▲0.093
無コール残	107,220	119,454	102,163	96,181
ON	67,222	80,751	66,425	58,018
その他	39,998	38,703	35,738	38,163
有コール残	20,217	20,175	20,392	20,033

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
	−		18:00	(欧)9月経常収支	−
	−			EU首脳会議	
	−			−	

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) 最低	最高	平均	レポ市場 東京レポレート
O/N	▲0.075	0.001	▲0.035	▲0.087
T/N	▲0.030	▲0.001	▲0.008	▲0.088
S/N	−	−	−	−
1W	▲0.025	0.020	▲0.018	▲0.089
2W	▲0.020	▲0.007	▲0.015	▲0.092
3W	−	−	−	▲0.096
1M	▲0.025	▲0.020	▲0.022	▲0.100
2M	−	−	−	−
3M	−	−	−	▲0.113
6M	−	−	−	▲0.135
1Y	−	−	−	▲0.157

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

本日の無担保コールON物は▲0.025%の出合から始まり、その後は主に▲0.065%～▲0.015%の水準で出合が見られた。
新積み期に入り数日たったものの様子見姿勢が強い金融機関が多く、同加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.002%の▲0.035%となった。

[%]

都銀・信託	証券	地銀
▲ 0.070 ～ ▲ 0.065	▲ 0.040 ～ ▲ 0.040	▲ 0.050 ～ ▲ 0.020

翌営業日のマーケット

出合水準は、本日対比で概ね横ばいを想定。

資金需給 [億円]

	日銀速報 11月18日		日銀予想 11月19日		当社需給予想 11月20日	
券		▲300		▲1,200		▲1,000
財政		▲1,000		▲1,400		▲12,000
過不足		▲1,300		▲2,600		▲13,000
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
国庫短期証券買入		+10,000				
国債買入		+13,600				
共通担保(全店)	▲1,600	+1,400				
CP等買入	▲800		▲100			+2,000
ETF買入				+700		
国債補完供給	+500	▲400	+400			
当座預金増減		+21,400		▲1,600		▲11,000
当座預金残高		4,822,400		4,820,800		4,809,800
準備預金残高		4,225,600	主な需給要因			
積み終了先		4,212,400				
超過準備		4,199,400				
非準預先残高		596,800	国債発行(20年)		国庫短期証券発行・償還(1Y) 国債償還(変動15年)	
準備預金進捗率		99.5%				
平均		10.0%				
乖離率		89.5%				

11月18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
社債等買入(11/20～)	2,000	2,900	2,000	0.043	0.077	39.9
国債補完供給(11/18～11/19)		353	353	▲0.350	▲0.350	
		0	0			

マネタリーベース [億円]
11月17日時点 5,986,700

所要 [億円]

今積期の所要準備額	3,451,500
11月19日以降の残り所要	
積数	17,100
平均	600

国庫短期証券入札予定

11月19日	1年	第952回
11月20日	3ヶ月	第953回
11月24日	6ヶ月	第954回
11月27日	3ヶ月	

国債入札予定

11月25日	40年
11月27日	2年
12月1日	10年
12月3日	30年

今月の国債買入オペ予定 [億円]

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	1,000～2,000	1,500	月2回程度	11月9日	1
1年超3年以下	3,500～6,500	5,000	5 11 17 24 26	11月17日	2
3年超5年以下	2,500～6,000	4,200	5 11 17 24 30	11月17日	2
5年超10年以下	2,500～6,000	4,200	9 11 17 24 26	11月17日	2
10年超25年以下	500～2,000	1,200	9 26	11月9日	1
25年超	0～500	300	5 30	11月5日	1
物価連動債	300	300	月2回程度	11月11日	1
変動利付債<偶数月>	500	500	月1回	10月7日	−

1年前の市場推移　○2019年11月積み期 [11月15日～12月13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。

上田八木短資株式会社 登録金融機関 近畿財務局長(登金)第 243号 加入協会 日本証券業協会