

# DAILY SIGNAL 上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

2019年11月13日(水)

## 短期市場の推移

	11月7日	11月8日	11月11日	11月12日
加重平均金利	▲0.038	▲0.050	▲0.065	▲0.070
東京レポレート(ON)	▲0.103	▲0.104	▲0.164	▲0.211
無コール残	87,464	87,485	76,293	70,128
ON	63,944	54,545	42,103	44,358
その他	23,520	32,940	34,190	25,770
有コール残	18,756	18,392	15,025	14,844

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14日の予定(時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
8:50	国内総生産(GDP)速報値 [前期比年率]	+0.9%	11:00	(米)10月鉱工業生産指数 [前年比]	5.4%
	-		22:30	(米)10月生産者物価コア 指数[前年比]	-
	-		22:30	(米)新規失業保険申請 件数[前週分]	-

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	▲0.087	0.001	▲0.072	▲0.108
T/N	-	-	-	▲0.132
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.055	▲0.030	▲0.043	▲0.121
2W	▲0.020	▲0.010	▲0.018	▲0.117
3W	-	-	▲0.040	▲0.117
1M	-	-	▲0.030	▲0.118
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.134
6M	-	-	-	▲0.169
1Y	-	-	-	▲0.187

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▲0.075%の出合から始まり、その後は主に▲0.087%~▲0.070%の水準で取引された。前営業日に引き続き、ビッドサイドの調達意欲が弱かったが、本日BCP訓練が行われたものの同加重平均金利(速報)は前日対比▲0.002%の▲0.072%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.087 ~ 0.001	▲0.085 ~ 0.001	▲0.087 ~ 0.001

## 翌営業日のマーケット

引き続きビッドサイドの調達意欲は弱く、軟調な地合を予想。

## 資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	11月13日	11月14日	11月14日	11月15日	11月15日	11月16日
券	+700	▲500	▲500	▲1,000	▲1,000	▲1,000
財政	▲9,700	+1,200	+1,200	▲8,000	▲8,000	▲8,000
過不足	▲9,000	+700	+700	▲9,000	▲9,000	▲9,000
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		+1,000				
共通担保(全店)		+100	▲100	▲100	▲100	▲100
CP等買入	▲100		▲100	▲100	▲100	▲100
国債補完供給		▲200	+200			
当座預金増減	▲8,200	+700	+700	▲9,000	▲9,000	▲9,000
当座預金残高	4,049,800	4,050,500	4,050,500	4,041,500	4,041,500	4,041,500
準備預金残高	3,499,300					
積み終了先	3,499,100					
超過準備	3,499,100					
非準備預金残高	550,500					
準備預金進捗率	99.9%					
平均	93.5%					
乖離率	6.4%					

## 11月13日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	接分
米ドル資金供給(11/15~11/21)		1	1	2.080	2.080	
国債補完供給(11/13~11/14)	170	170	▲0.350	▲0.350		
	8	8	▲0.350	▲0.350		
共通担保(全店)(11/13~11/14)	1,000	50	50			

マナタリーベース	所要
11月12日時点 5,179,200	今積期の所要準備額 3,197,900
	11月14日以降の残り所要積数 100
	平均 0

## 国庫短期証券入札予定

11月15日	3ヶ月	第870回
11月19日	1年	第871回
11月22日	3ヶ月	
11月29日	3ヶ月	
11月14日	5年	
11月20日	20年	
11月26日	40年	
11月28日	2年	

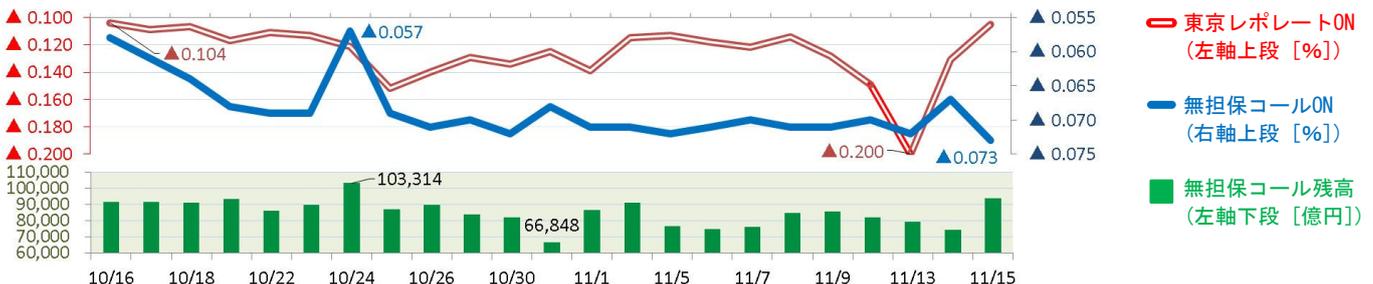
## 今月の国債買入オペ予定

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11日	1
1年超3年以下	3,000~5,500 程度	4,200			
3年超5年以下	2,000~4,500 程度	3,400	5 11 19 25	11月11日	2
5年超10年以下	2,000~5,000 程度	3,500	1 11 19 27	11月11日	2
10年超25年以下	500~2,000 程度	1,000			
25年超	0~500 程度	300	5 15 25	11月5日	2
物価連動債	300 程度	300	月2回程度	11月1日	1
変動利付債<偶数月>	1,000 程度	1,000	-	10月15日	-

## 1年前の市場推移

○2018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。