

DAILY SIGNAL 上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

2019年11月18日(月)

短期市場の推移

	11月12日	11月13日	11月14日	11月15日
加重平均金利	▲0.070	▲0.072	▲0.074	▲0.063
東京レポレート(ON)	▲0.211	▲0.108	▲0.086	▲0.075
無コール残	70,128	78,985	85,356	82,845
ON	44,358	52,965	59,051	59,280
その他	25,770	26,020	26,305	23,565
有コール残	14,844	16,002	22,178	21,777

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
-	-	22:30	(米)10月住宅着工件数 131.8万戸
-	-	-	-

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	▲0.058	▲0.081
T/N	-	-	-	▲0.077
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.030	▲0.005	▲0.024	▲0.079
2W	▲0.040	▲0.010	▲0.031	▲0.081
3W	-	-	-	▲0.086
1M	-	-	-	▲0.093
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.124
6M	-	-	-	▲0.170
1Y	-	-	-	▲0.188

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▲0.060%の出合から始まり、その後は主に▲0.080%~▲0.045%の水準で取引された。積み初日ということもあり、調達を限定する先も散見されたため、落ち着いた展開となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.080 ~ ▲0.070	▲0.060 ~ ▲0.060	▲0.080 ~ ▲0.045

翌営業日のマーケット

出合の水準レートは▲0.070%~▲0.040%になると予想。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	11月18日	11月19日	11月19日	11月20日	11月20日	11月21日
券	+600	+200	+600	+200	+1,000	+1,000
財政	▲500	▲3,100	▲500	▲3,100	+8,000	+8,000
過不足	+100	▲2,900	+100	▲2,900	+7,000	+7,000
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		+1,500				
CP等買入	▲100		▲100			
国債補完供給	+400	▲300	+300			
当座預金増減	+1,600	▲2,700	+1,600	▲2,700	+7,000	+7,000
当座預金残高	4,042,600	4,039,900	4,042,600	4,039,900	4,046,900	4,046,900
準備預金残高	3,525,400		3,525,400			
積み終了先	3,492,200		3,492,200			
超過準備	3,466,200		3,466,200			
非準預先残高	517,200		517,200			
準備預金進捗率	98.5%		98.5%			
平均	10.0%		10.0%			
乖離率	88.5%		88.5%			

11月18日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	接分
国債補完供給(11/18~11/19)	270	270	▲0.350	▲0.350		
	5	5	▲0.350	▲0.350		

マネタリーベース [億円]
11月15日時点 5,161,900

所要 [億円]
今積期の所要準備額 3,107,700
11月19日以降の残り所要積数 45,800
平均 1,700

国庫短期証券入札予定

11月19日	1年	第87/1回
11月22日	3ヶ月	第87/2回
11月29日	3ヶ月	
12月6日	3ヶ月	
11月20日	20年	
11月26日	40年	
11月28日	2年	
12月3日	10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15日	1
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11月積み期 [11月16日~12月14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(登号)第243号 加入協会 日本証券業協会