

DAILY SIGNAL 上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

2019年11月27日(水)

短期市場の推移

	11月21日	11月22日	11月25日	11月26日
加重平均金利	▲0.039	▲0.030	▲0.027	▲0.018
東京レポレート(ON)	▲0.083	▲0.078	▲0.079	▲0.081
無コール残	77,948	81,601	69,492	90,662
ON	49,173	50,876	42,877	62,647
その他	28,775	30,725	26,615	28,015
有コール残	19,781	19,990	20,146	19,622

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28日の予定(時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
8:50 小売売上高(10月)	▲10.5%	18:00 (欧)ユーロ圏 マネーサプライ(10月)	5.5%
8:50 百貨店・スーパー売上高(10月)	▲6.7%	-	-
12:30 黒田日銀総裁講演	-	-	-

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	▲0.060	0.001	▲0.023	▲0.075
T/N	-	-	-	▲0.076
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.023	▲0.020	▲0.022	▲0.077
2W	▲0.040	▲0.010	▲0.020	▲0.079
3W	-	-	-	▲0.086
1M	-	-	▲0.025	▲0.095
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.122
6M	-	-	-	▲0.168
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▲0.020%の割合から始まった。その後は主に▲0.030%~▲0.020%の水準で取引された。昨日同様ビットサイドの調達ニーズは強かったが、試取りの影響が剥落し、加重平均金利は前日対比-0.005%の▲0.023%(速報)となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.030 ~ ▲0.025	▲0.020 ~ ▲0.020	▲0.030 ~ ▲0.015

翌営業日のマーケット

出合の水準は▲0.040%~▲0.020%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27日	11月28日	11月28日	11月29日	11月29日	11月29日
券	▲700	▲1,500	▲1,500	▲1,300	▲1,300	▲1,300
財政	▲7,500	▲200	▲200	+3,600	+3,600	+3,600
過不足	▲8,200	▲1,700	▲1,700	+2,300	+2,300	+2,300
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				
国債買入			+4,600			
CP等買入	▲200		▲300			
社債等買入			▲100			+1,000
国債補完供給	+300	▲300	+300			
当座預金増減	▲7,400	+2,800	+2,800	+3,300	+3,300	+3,300
当座預金残高	4,044,100	4,046,900	4,046,900	4,050,200	4,050,200	4,050,200
準備預金残高	3,517,400					
積み終了先	3,516,800					
超過準備	3,516,800					
非準備先残高	526,700					
準備預金進捗率	99.7%					
平均	40.0%					
乖離率	59.7%					

11月27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(11/28~)						
~1年	500	1,308	500	0.012	0.027	74.8
5~10年	3,500	10,377	3,510	▲0.010	▲0.009	42.3
物価連動	300	1,523	303	▲0.010	▲0.098	34.4
国債補完供給(11/27~11/28)			287	287	▲0.350	▲0.350

マナタリーベース [億円]
11月26日時点 5,174,600

所要 [億円]
今積期の所要準備額 3,107,700
11月28日以降の残り所要積数 7,900
平均 400

国庫短期証券入札予定

11月29日	3ヶ月	第8/3回
12月6日	3ヶ月	
12月9日	6ヶ月	
12月13日	3ヶ月	
11月28日	2年	
12月3日	10年	
12月5日	30年	
12月10日	5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27日	0
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25日	0
5年超10年以下	2,000~5,000 程度	3,500	1 11 19 27	11月27日	0
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25日	0
物価連動債	300 程度	300	月2回程度	11月27日	0
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