

# DAILY SIGNAL

上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

平成30年11月1日(木)

## 短期市場の推移

[億円] [%]

	10月26日	10月29日	10月30日	10月31日
加重平均金利	▲0.071	▲0.070	▲0.072	▲0.068
東京レポレート(ON)	▲0.140	▲0.129	▲0.134	▲0.125
無コール残	89,676	84,109	81,957	66,848
ON	55,911	50,344	49,212	34,528
その他	33,765	33,765	32,745	32,320
有コール残	14,131	14,186	14,219	11,652

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2日の予定(時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
8:50	マネタリーベース(10月)	-	21:30 (米)8月貿易収支	▲528億米ドル
10:00	営業毎旬報告(10月31日現在)	-	21:30 (米)10月雇用統計	-
17:00頃	日本銀行が保有する国債の銘柄別残高	-		

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	▲0.139
T/N	-	-	▲0.010	▲0.146
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	▲0.040	▲0.148
2W	-	-	▲0.033	▲0.146
3W	-	-	-	▲0.146
1M	-	-	▲0.020	▲0.148
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▲0.085%の出合から始まった。その後は、主に▲0.086%~▲0.040%の水準で取引された。同加重平均金利(速報値)は前営業日対比▲0.003%の▲0.071%となった。

都銀・信託		証券	地銀
▲0.086 ~ ▲0.086		▲0.085 ~ ▲0.085	▲0.086 ~ ▲0.040

## 翌営業日のマーケット

ビッドサイドの慎重な調達姿勢は明日も継続し、本日と同様の軟調な地合を予想する。

## 資金需給

[億円]

	日銀速報	日銀予想	当社需給予想
	11月1日	11月2日	11月5日
券	▲800	▲500	+1,000
財政	▲28,500	▲31,100	▲3,000
過不足	▲29,300	▲31,600	▲2,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
共通担保(全店)			
CP等買入		▲100	▲1,500
ETF買入		+100	
国債補完供給	+200	▲900	+900
当座預金増減	▲30,000	▲30,700	▲3,500
当座預金残高	3,940,300	3,909,600	3,906,100
準備預金残高	3,449,200	主な需給要因	
積み終了先	3,448,600	法人税・消費税・保険揚げ	国庫短期証券発行・償還(3M)
超過準備	3,448,600	国債発行(10年)	
非準備先残高	491,100		
準備預金進捗率	99.8%		
平均	54.8%		
乖離率	45.0%		

11月1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
国債補完供給(11/1~11/2)	173,945	777	777	▲0.600	▲0.600	
	6,739	7	7	▲0.600	▲0.600	

マネタリーベース [億円]  
10月31日時点 5,068,800

所要	[億円]
今積期の所要準備額	3,102,700
11月2日以降の残り所要積数	5,000
平均	400

## 国庫短期証券入札予定

11月2日	3ヶ月
11月8日	6ヶ月
11月9日	3ヶ月
11月16日	3ヶ月
11月6日	物価連動
11月13日	30年
11月15日	5年
11月20日	20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	10月24日	2
1年超3年以下	2,500~4,500 程度	3,000			
3年超5年以下	3,000~5,500 程度	3,500	2 9 19 28	10月30日	4
5年超10年以下	3,000~6,000 程度	4,500	2 12 16 26 30	10月26日	5
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	10月30日	5
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	0

## 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。 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