

DAILY SIGNAL 上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

平成30年11月7日(水)

短期市場の推移

[億円][%]

11月8日の予定(時刻は日本時間)

	11月1日	11月2日	11月5日	11月6日
加重平均金利	▲0.071	▲0.071	▲0.072	▲0.071
東京レポレート(ON)	▲0.139	▲0.115	▲0.113	▲0.118
無コール残	86,584	91,293	76,599	74,887
ON	54,064	56,623	42,029	42,547
その他	32,520	34,670	34,570	32,340
有コール残	14,035	17,912	16,811	14,266

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。

	日本	予想	海外	予想
8:50	9月国際収支(経常収支)	17838億円	22:30	(米)新規失業保険申請件数[前週分]
8:50	金融政策決定会合における主な意見(10月30~31日分)	-	-	-
-	【記者会見】布野審議委員(11月7日)	-	-	-

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	▲0.070	▲0.122
T/N	-	-	▲0.010	▲0.149
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.045	▲0.020	▲0.037	▲0.145
2W	▲0.045	▲0.042	▲0.043	▲0.146
3W	-	-	-	▲0.146
1M	-	-	0.005	▲0.149
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+0.001%の▲0.07%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.086 ~ ▲0.086	- ~ -	▲0.086 ~ ▲0.055

翌営業日のマーケット

本日と同様に調達サイドが慎重な姿勢となり、軟調な地合いを予想する。

資金需給

[億円]

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	11月7日	11月8日	11月8日	11月9日	11月9日	11月9日
券	+700	▲200	▲200	+0	+0	+0
財政	▲3,800	▲200	▲200	▲4,000	▲4,000	▲4,000
過不足	▲3,100	▲400	▲400	▲4,000	▲4,000	▲4,000
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					
CP等買入		▲100				
ETF買入		+100				+2,000
国債補完供給	+100		+100			
当座預金増減	▲2,000	▲400	▲400	▲2,000	▲2,000	▲2,000
当座預金残高	3,920,900	3,920,500	3,920,500	3,918,500	3,918,500	3,918,500
準備預金残高	3,436,100	主な需給要因				
積み終了先	3,435,500					
超過準備	3,435,500					
非準備預金残高	484,800					
準備預金進捗率	99.9%					
平均	74.2%					
乖離率	25.7%					

11月7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(11/7~11/8)	11,713	24	24	▲0.600	▲0.600	

マナタリーベース [億円]

11月6日時点 5,021,100

所要

今積期の所要準備額 3,105,100

11月8日以降の残り所要積数	1,400
平均	200

国庫短期証券入札予定

11月8日	6ヶ月	第794回
11月9日	3ヶ月	第795回
11月16日	3ヶ月	
11月19日	1年	
11月13日	30年	
11月15日	5年	
11月20日	20年	
11月27日	40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5日	1
1年超3年以下	2,500~4,500 程度	3,500			
3年超5年以下	3,000~5,500 程度	4,000	2	9 19 28	11月2日 3
5年超10年以下	3,000~6,000 程度	4,500	2	12 16 26 30	11月2日 4
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	11月5日 4
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	1

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