

DAILY SIGNAL

上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

平成30年11月12日(月)

短期市場の推移

[億円][%]

11月13日の予定(時刻は日本時間)

	11月6日	11月7日	11月8日	11月9日
加重平均金利	▲0.071	▲0.070	▲0.071	▲0.071
東京レポレート(ON)	▲0.118	▲0.122	▲0.114	▲0.128
無コール残	74,887	76,207	84,738	85,934
ON	42,547	42,017	43,118	43,044
その他	32,340	34,190	41,620	42,890
有コール残	14,266	14,983	20,062	13,498

	日本	予想	海外	予想
10:00	営業毎旬報告 (11月10日現在)	-	18:30 (英)9月ILO失業率 (3カ月)	4.0%
17:00頃	日本銀行が保有する 国債の銘柄別残高	-	(米)10月 月次財政収支	
17:00頃	日本銀行による 国庫短期証券の 銘柄別買入額	-	(米)ミネアポリス 連銀総裁講演	

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。

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	▲0.149
T/N	-	-	▲0.015	▲0.200
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.045	▲0.028	▲0.037	▲0.185
2W	-	-	-	▲0.173
3W	-	-	-	▲0.167
1M	-	-	-	▲0.167
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.161
6M	-	-	-	▲0.155
1Y	-	-	-	▲0.160

本日の市況

無担保コールON物は▲0.086%の出合から始まった。
その後は主に▲0.086%~▲0.050%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▲0.071%となった。

	都銀・信託	証券	地銀
	▲0.086 ~ ▲0.086	▲0.086 ~ ▲0.086	▲0.086 ~ ▲0.050

翌営業日のマーケット

ビッドサイドの調達姿勢は変わらず、軟調な地合が継続すると予想する。

資金需給

[億円]

	日銀速報 11月12日	日銀予想 11月13日	当社需給予想 11月14日
券	+800	+300	+0
財政	▲10,300	▲2,000	▲6,000
過不足	▲9,500	▲1,700	▲6,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国債買入	+10,000	+4,900	スタート
共通担保(全店)	▲2,100	+2,200	
CP等買入	▲200	▲600	
ETF買入	+300		
国債補完供給	▲2,800	+2,800	
当座預金増減	▲2,100	+5,400	▲6,000
当座預金残高	3,917,600	3,923,000	3,917,000
準備預金残高	3,436,700	主な需給要因	
積み終了先	3,436,600		
超過準備	3,436,600		
非準備預金残高	480,900	源泉税揚げ 国債発行(30年)	
準備預金進捗率	99.9%		
平均	90.3%		
乖離率	9.6%		

11月12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
国債買入(11/13~)						
5~10年	4,500	13,133	4,515	▲0.004	▲0.004	73.6
物価連動	250	1,373	251	▲0.070	▲0.086	76.2
国債補完供給(11/12~11/13)						
	30,236	2,613	2,613	▲0.600	▲0.600	
	1,000	78	78	▲0.600	▲0.600	

マナタリーベース [億円]	所要 [億円]
11月9日時点 5,016,800	今積期の所要準備額 3,105,100
	11月13日以降の残り所要積数 300
	平均 100

国庫短期証券入札予定

今月の国債買入オペ予定

11月16日	3ヶ月	第796回
11月19日	1年	第797回
11月22日	3ヶ月	
11月30日	3ヶ月	
11月13日	30年	
11月15日	5年	
11月20日	20年	
11月27日	40年	

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9日	2
5年超10年以下	3,000~6,000 程度	4,500	2 12 16 26 30	11月12日	3
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9日	3
物価連動債	250 程度	250	月2回程度	11月12日	1
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。