

DAILY SIGNAL 上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

平成30年11月14日(水)

短期市場の推移

[億円] [%]

11月15日の予定 (時刻は日本時間)

	11月8日	11月9日	11月12日	11月13日
加重平均金利	▲0.071	▲0.071	▲0.070	▲0.072
東京レポレート(ON)	▲0.114	▲0.128	▲0.149	▲0.200
無コール残	84,738	85,934	82,088	79,451
ON	43,118	43,044	46,298	45,891
その他	41,620	42,890	35,790	33,560
有コール残	20,062	13,498	15,131	11,714

日本	予想	海外	予想
特になし		(米)11月ニューヨーク連銀 製造業景気指数	19.0
-		(米)10月小売売上高	0.5%
-		(米)新規失業保険 申請件数[前週分]	-

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	▲0.067	▲0.131
T/N	▲0.020	▲0.015	▲0.018	▲0.178
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.040	▲0.025	▲0.032	▲0.172
2W	▲0.040	▲0.005	▲0.033	▲0.172
3W	-	-	-	▲0.169
1M	-	-	0.000	▲0.164
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.162
6M	-	-	-	▲0.156
1Y	-	-	-	▲0.161

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+0.005%の▲0.067%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

積み最終日となる明日もビッドサイドの慎重な調達姿勢は変わらないと予想する。

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

資金需給

[億円]

	日銀速報	日銀予想	当社需給予想
	11月14日	11月15日	11月16日
券	+1,000	▲500	▲1,000
財政	▲5,300	+10,400	▲20,000
過不足	▲4,300	+9,900	▲21,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国庫短期証券買入	+1,000	-	+2,000
CP等買入	▲500	▲500	-
ETF買入	+1,100	-	-
国債補完供給	+1,500	+1,400	-
当座預金増減	▲2,600	+10,800	▲19,000
当座預金残高	3,918,900	3,929,700	3,910,700
準備預金残高	3,418,600	主な需給要因	
積み終了先	3,418,400		
超過準備	3,418,400		
非準備預金残高	500,300		
準備預金進捗率	99.9%	国債償還(2年)	国債発行(5年)
平均	96.8%		
乖離率	3.1%		

11月14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
米ドル資金供給(11/16~11/29)		0	0	2,700	2,700	
国債補完供給(11/14~11/15)	14,003	1,337	1,337	▲0.600	▲0.600	
共通担保(全店)(11/14~11/15)	1,000	49	49			

マナタリーベース [億円]	所要 [億円]
11月13日時点 5,017,500	今積期の所要準備額 3,105,100
	11月15日以降の残り所要積数 100
	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15日	5年	
11月20日	20年	
11月27日	40年	
11月29日	2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。