

DAILY SIGNAL 上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

平成30年11月15日(木)

短期市場の推移

[億円][%]

11月16日の予定(時刻は日本時間)

	11月9日	11月12日	11月13日	11月14日
加重平均金利	▲0.071	▲0.070	▲0.072	▲0.067
東京レポレート(ON)	▲0.128	▲0.149	▲0.200	▲0.131
無コール残	85,934	82,088	79,451	74,293
ON	43,044	46,298	45,891	42,283
その他	42,890	35,790	33,560	32,010
有コール残	13,498	15,131	11,714	16,298

日本	予想	海外	予想
17:00 業態別の日銀当座預金残高(10月)	-	19:00 (欧)10月ユーロ圏CPI改定値[前月比]	2.2%
-	-	23:15 (米)10月鉱工業生産指数[前月比]	0.2%
-	-	(米)シカゴ連銀総裁の講演	-

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	▲0.073	▲0.105
T/N	-	-	▲0.015	▲0.130
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.045	0.001	▲0.031	▲0.133
2W	▲0.043	▲0.030	▲0.039	▲0.136
3W	-	-	▲0.030	▲0.142
1M	▲0.035	0.000	▲0.030	▲0.146
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.159
6M	-	-	-	▲0.156
1Y	-	-	-	▲0.161

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

積み最終日となる本日の無担保コール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▲0.006%の▲0.073%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

新積み期初日であるため、ビッドサイドは慎重な調達姿勢となると予想する。

資金需給

[億円]

	日銀速報	日銀予想	当社需給予想
	11月15日	11月16日	11月19日
券	▲500	▲500	+0
財政	+12,200	▲22,500	▲3,000
過不足	+11,700	▲23,000	▲3,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
共通担保(全店)			▲1,800
CP等買入	▲500	▲100	+2,000
ETF買入			+700
国債補完供給	+1,400	▲4,000	+4,000
当座預金増減	+8,600	▲16,400	▲4,800
当座預金残高	3,927,500	3,911,100	3,906,300
準備預金残高	3,438,500	主な需給要因	
積み終了先	3,438,500	国債発行(5年)	
超過準備	3,438,400	国庫短期証券発行・償還(3M)	
非準預先残高	489,000		
準備預金進捗率	100.0%		
平均	100.0%		
乖離率	0.0%		

11月15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(11/15~11/16)	206,365	3,804	3,804	▲0.600	▲0.600	

マナタリーベース [億円]	所要 [億円]
11月14日時点 5,014,000	来積期の所要準備額 3,010,900
	11月16日以降の残り所要積数 3,010,900
	平均 100,400

国庫短期証券入札予定

今月の国債買入オペ予定

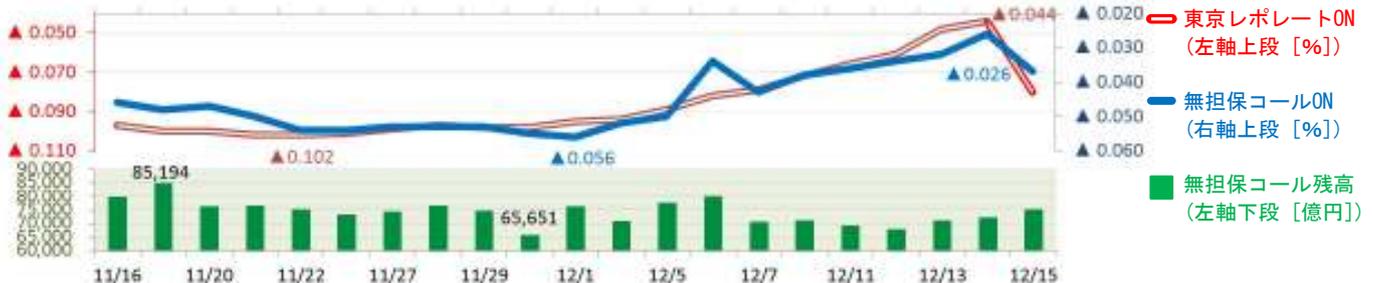
11月16日	3ヶ月	第796回
11月19日	1年	第797回
11月22日	3ヶ月	第798回
11月30日	3ヶ月	
11月20日	20年	
11月27日	40年	
11月29日	2年	
12月4日	10年	

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11月積み期 [11月16日~12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。