

DAILY SIGNAL 上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

平成30年11月20日(火)

短期市場の推移 [億円] [%]

	11月14日	11月15日	11月16日	11月19日
加重平均金利	▲0.067	▲0.073	▲0.072	▲0.068
東京レポレート(ON)	▲0.131	▲0.105	▲0.130	▲0.131
無コール残	74,293	94,093	91,082	79,996
ON	42,283	61,953	58,222	45,406
その他	32,010	32,140	32,860	34,590
有コール残	16,298	29,050	13,255	15,726

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21日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
8:50 預金種別店頭表示金利の平均年利率等	-	21:00 (米)MBA住宅ローン申請指数[前週比]	-
-	-	22:30 (米)10月耐久財受注[前月比]	-2.1%
-	-	22:30 (米)新規失業保険申請件数[前週分]	-

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 東京レポレート
	最低	最高	平均	
O/N	▲0.086	0.030	▲0.066	▲0.137
T/N	▲0.015	0.030	0.000	▲0.166
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.045	▲0.035	▲0.043	▲0.163
2W	▲0.035	▲0.008	▲0.026	▲0.164
3W	-	-	-	▲0.163
1M	-	-	▲0.022	▲0.162
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.166
6M	-	-	-	▲0.160
1Y	-	-	-	▲0.162

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、▲0.086%の合出から始まった。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+0.002%の▲0.066%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

調達姿勢に大きな変化はなく、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		日銀予想		当社需給予想	
	11月20日	11月21日	11月21日	11月22日	11月22日	11月23日
券	▲1,000	▲1,600	▲1,600	▲2,000	▲2,000	▲2,000
財政	▲1,900	▲12,600	▲12,600	+2,000	+2,000	+2,000
過不足	▲2,900	▲14,200	▲14,200	+0	+0	+0
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
国債買入		+8,100				
CP等買入	▲300					
ETF買入		+500				
国債補完供給	+700	▲300	+300			
当座預金増減	+5,800	▲13,900	▲13,900	+0	+0	+0
当座預金残高	3,920,400	3,906,500	3,906,500	3,906,500	3,906,500	3,906,500
準備預金残高	3,414,800					
積み終了先	3,407,400					
超過準備	3,403,500					
非準備先残高	505,600					
準備預金進捗率	99.2%					
平均	16.7%					
乖離率	82.5%					

11月20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
社債等買入(11/27~)	750	1,927	750	▲0.023	▲0.015	63.8
国債補完供給(11/20~11/21)	40,165	272	272	▲0.600	▲0.600	
	10,931	8	8	▲0.600	▲0.600	

マナタリーベース [億円]	所要 [億円]
11月19日時点 5,010,800	今積期の所要準備額 3,010,900
	11月21日以降の残り所要積数 25,100
	平均 1,000

国庫短期証券入札予定

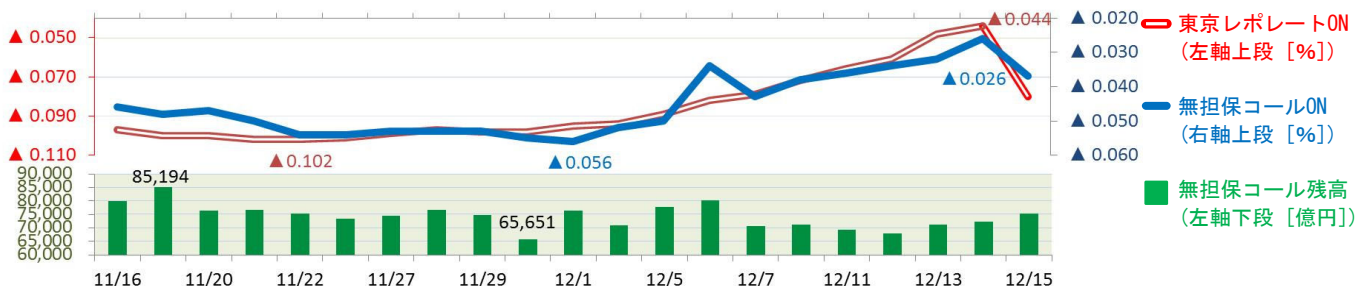
11月22日	3ヶ月	第798回
11月30日	3ヶ月	
12月6日	6ヶ月	
12月7日	3ヶ月	
11月27日	40年	
11月29日	2年	
12月4日	10年	
12月11日	30年	

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19日	0
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19日	1
5年超10年以下	3,000~6,000 程度	4,500	2 12 16 26 30	11月16日	2
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16日	2
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。