

DAILY SIGNAL

上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

平成30年11月22日(木)

短期市場の推移

[億円] [%]

	11月16日	11月19日	11月20日	11月21日
加重平均金利	▲0.072	▲0.068	▲0.066	▲0.069
東京レポレート(ON)	▲0.130	▲0.131	▲0.137	▲0.137
無コール残	91,082	79,996	77,927	84,506
ON	58,222	45,406	42,987	49,596
その他	32,860	34,590	34,940	34,910
有コール残	13,255	15,726	13,596	14,191

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。

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	▲0.071	▲0.134
T/N	-	-	▲0.015	▲0.167
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.038	▲0.035	▲0.037	▲0.177
2W	-	-	▲0.040	▲0.174
3W	▲0.040	▲0.005	▲0.023	▲0.172
1M	-	-	-	▲0.173
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.177
6M	-	-	-	▲0.163
1Y	-	-	-	▲0.164

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

11月26日の予定(時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
8:50	国内銀行の資産・負債等(銀行勘定)(9月末)	-	18:00	(独)11月IFO企業景況感指数
8:50	貸出約定平均金利(9月)	-	22:30	(米)10月シカゴ連銀全米活動指数
	-	-	-	-

経済指標及び予想値は株式会社フィスコ提供

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。週末であったものの、調達姿勢に変化はなく、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▲0.071%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

週明けも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	日銀予想	当社需給予想
	11月22日	11月26日	11月27日
券	▲2,000	▲200	+0
財政	+8,800	▲8,800	+3,000
過不足	+6,800	▲9,000	+3,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国庫短期証券買入	+1,000		
共通担保(全店)		▲2,200	+2,600
CP等買入	▲600	▲100	
社債等買入	▲200	▲100	+800
ETF買入		+1,200	
国債補完供給	+200		
当座預金増減	+7,200	▲7,600	+3,800
当座預金残高	3,912,200	3,904,600	3,908,400
準備預金残高	3,402,300	主な需給要因	
積み終了先	3,401,000		
超過準備	3,399,700		
非準備預金残高	509,900		
準備預金進捗率	99.8%	国庫短期証券発行・償還(3M)	
平均	33.3%		
乖離率	66.4%		

11月22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	按分
国債補完供給(11/22~11/26)	93,835	11	11	▲0.600	▲0.600	
共通担保(全店)(11/26~12/10)	8,000	2,641	2,641			

マネタリーベース

[億円]

11月21日時点 5,003,900

所要

[億円]

今積期の所要準備額 3,011,000

11月26日以降の残高所要

積数 7,300

平均 400

国庫短期証券入札予定

11月30日 3ヶ月 第799回
12月6日 6ヶ月
12月7日 3ヶ月
12月14日 3ヶ月
国債入札予定
11月27日 40年
11月29日 2年
12月4日 10年
12月11日 30年

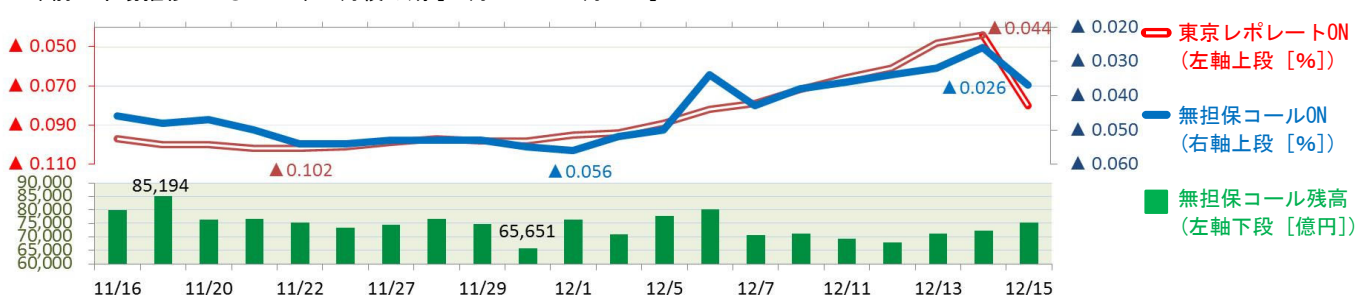
今月の国債買入オペ予定

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	2 9 19 28	11月19日	1
3年超5年以下	3,000~5,500 程度	4,000	2 12 16 26 30	11月16日	2
5年超10年以下	3,000~6,000 程度	4,500	5 9 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			
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。

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