

DAILY SIGNAL

上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

平成30年11月27日(火)

短期市場の推移

	11月20日	11月21日	11月22日	11月26日
加重平均金利	▲0.066	▲0.069	▲0.071	▲0.070
東京レポレート(ON)	▲0.137	▲0.137	▲0.134	▲0.126
無コール残	77,927	84,506	89,992	80,786
ON	42,987	49,596	55,902	47,796
その他	34,940	34,910	34,090	32,990
有コール残	13,596	14,191	13,207	20,739

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28日の予定(時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	(米)7-9月期GDP 改定値 [前期比年率]	3.6%
-	-	(米)週間MBA住宅 ローン申請指数	-
-	-	(米)パウエルFRB議長講演	-

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	▲0.126
T/N	-	-	▲0.015	▲0.165
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.045	0.000	▲0.028	▲0.179
2W	▲0.010	0.000	▲0.007	▲0.176
3W	-	-	-	▲0.174
1M	-	-	-	▲0.175
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.175
6M	-	-	-	▲0.164
1Y	-	-	-	▲0.163

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%の水準で取引される軟調な地合となった。
 同加重平均金利(速報値)は前営業日対比▲0.003%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

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

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	11月27日	11月28日	11月28日	11月29日	11月29日	11月29日
券	▲300	▲400	▲400	▲1,000	▲1,000	▲1,000
財政	+1,500	▲6,800	▲6,800	+2,000	+2,000	+2,000
過不足	+1,200	▲7,200	▲7,200	+1,000	+1,000	+1,000
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
国庫短期証券買入				+1,000		
国債買入		+7,200				
CP等買入	▲200		▲200			
社債等買入		+800	▲100			
ETF買入		+300				
国債補完供給	+200	▲100	+100			
当座預金増減	+9,400	▲6,400	▲6,400	+1,000	+1,000	+1,000
当座預金残高	3,911,400	3,905,000	3,905,000	3,906,000	3,906,000	3,906,000
準備預金残高	3,418,700					
積み終了先	3,417,200					
超過準備	3,417,200					
非準備先残高	492,700					
準備預金進捗率	99.9%					
平均	40.0%					
乖離率	59.9%					

11月27日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	接分
国庫短期証券買入(11/28~)	1,000	6,968	1,000	0.020	0.045	5.6
米ドル資金供給(11/29~12/6)			0	0	2.700	2.700
CP等買入(11/30~)	2,000	5,582	1,970	▲0.002	0.002	85.7
国債補完供給(11/27~11/28)	30,515	124	124	▲0.600	▲0.600	

マナタリーベース	所要
11月26日時点 5,003,100	今積期の所要準備額 3,011,000
	11月28日以降の残り所要積数 4,300
	平均 200

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	
11月29日	2年	
12月4日	10年	
12月11日	30年	
12月13日	5年	

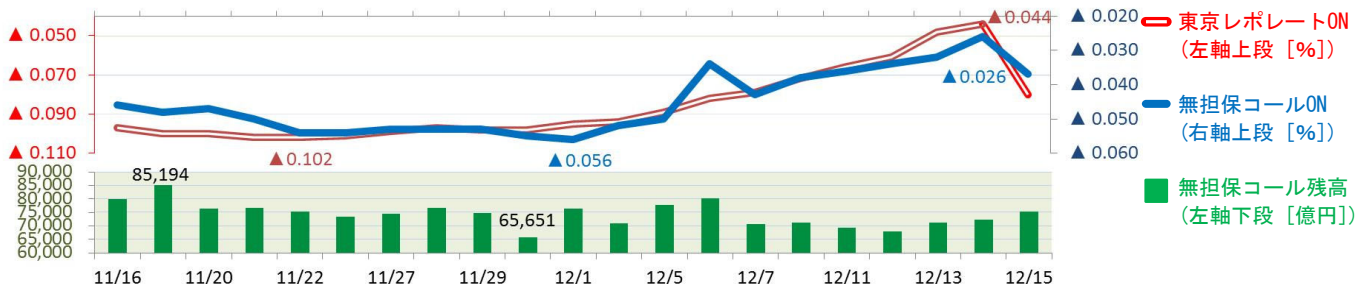
今月の国債買入オペ予定

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 9 16 26 30	11月26日	1
5年超10年以下	3,000~6,000 程度	4,500	2 9 16 26 30	11月26日	1
10年超25年以下	1,500~2,500 程度	1,800	5 9 16 26 30	11月26日	1
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。