

# DAILY SIGNAL 上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

平成30年11月19日(月)

## 短期市場の推移

	11月13日	11月14日	11月15日	11月16日
加重平均金利	▲0.072	▲0.067	▲0.073	▲0.072
東京レポレート(ON)	▲0.200	▲0.131	▲0.105	▲0.130
無コール残	79,451	74,293	94,093	91,082
ON	45,891	42,283	61,953	58,222
その他	33,560	32,010	32,140	32,860
有コール残	11,714	16,298	29,050	13,255

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20日の予定(時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	22:30 (米)10月住宅着工件数	122.5万戸
-	-	22:30 (米)10月住宅建設許可件数	126.0万戸
-	-	-	-

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	▲0.068	▲0.131
T/N	-	-	▲0.015	▲0.165
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.050	▲0.035	▲0.044	▲0.152
2W	▲0.040	▲0.038	▲0.039	▲0.155
3W	-	-	▲0.012	▲0.155
1M	-	-	-	▲0.157
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.163
6M	-	-	-	▲0.158
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

無担保コールON物は、▲0.086%の合出から始まった。先週から調達姿勢に大きな変化はなく、その後は主に▲0.086%~▲0.045%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+0.004%の▲0.068%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.086 ~ ▲0.086	▲0.086 ~ ▲0.086	▲0.086 ~ ▲0.045

## 翌営業日のマーケット

引続き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19日	11月20日	11月21日
券	+0	▲1,000	▲1,000
財政	▲1,500	▲1,300	▲13,000
過不足	▲1,500	▲2,300	▲14,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国債買入	+7,100	+8,100	スタート
共通担保(全店)	▲1,800	+1,500	
CP等買入		▲300	
ETF買入		+500	
国債補完供給	+700	▲700	+700
当座預金増減	+5,300	+6,700	▲14,000
当座預金残高	3,914,600	3,921,300	3,907,300
準備預金残高	3,426,700	主な需給要因	
積み終了先	3,409,400	国庫短期証券	
超過準備	3,406,000	発行・償還(1Y)	
非準備先残高	487,900	国債発行	
準備預金進捗率	98.8%	(20年)	
平均	13.3%	国債償還	
乖離率	85.5%	(変動15年)	

## 11月19日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	接分
国債買入(11/20~)						
~1年	500	1,263	500	0.024	0.025	97.2
1~3年	3,500	10,111	3,502	▲0.003	▲0.002	7.8
3~5年	4,000	9,086	4,007	▲0.005	▲0.005	91.5
国債補完供給(11/19~11/20)						
	76,073	651	651	▲0.600	▲0.600	

マナタリーベース	所要
11月16日時点 5,005,500	今積期の所要準備額 3,010,900
	11月20日以降の残り所要積数 36,400
	平均 1,400

## 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20日	20年	
11月27日	40年	
11月29日	2年	
12月4日	10年	

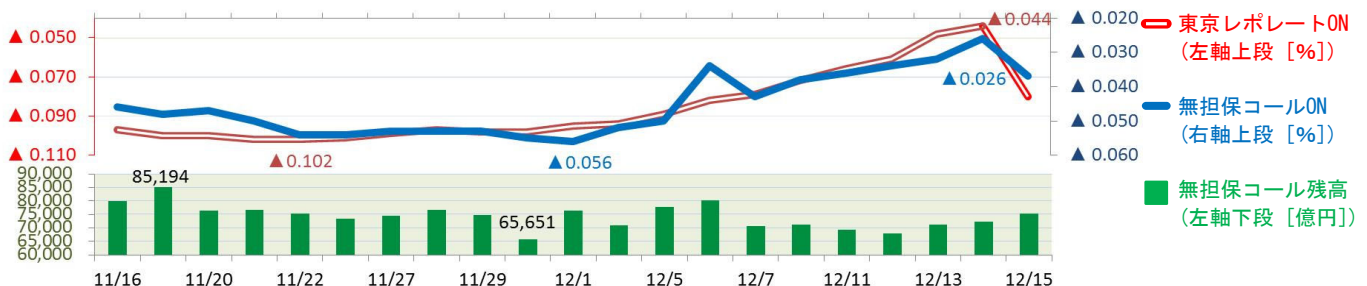
## 今月の国債買入オペ予定

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ありません。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(登号)第243号 加入協会 日本証券業協会