

# DAILY SIGNAL 上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

2020年11月2日(月)

## 短期市場の推移

	10月27日	10月28日	10月29日	10月30日
加重平均金利	▲0.019	▲0.024	▲0.026	▲0.029
東京レポレート(ON)	▲0.078	▲0.084	▲0.091	▲0.093
無コール残	98,993	107,088	108,529	114,430
ON	55,980	62,575	62,516	71,397
その他	43,013	44,513	46,013	43,033
有コール残	21,282	18,613	19,307	20,057

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4日の予定(時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
8:50	マナターベース(10月)	-	22:15	(米)10月ADP 全米雇用報告	73.8万人
8:50	政策委員会・金融政策決定会 議事要旨(9月16・17日分)	-	22:30	(米)9月貿易収支	-670億米ドル
10:00	営業毎旬報告(10月31日現在)	-		FOMC(5日まで)	

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	▲0.060	0.001	▲0.030	▲0.086
T/N	▲0.015	▲0.001	▲0.004	▲0.090
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.025	0.000	▲0.020	▲0.090
2W	▲0.025	▲0.010	▲0.016	▲0.090
3W	-	-	-	▲0.092
1M	▲0.025	0.000	▲0.011	▲0.101
2M	-	-	-	-
3M	0.030	0.080	0.055	▲0.111
6M	-	-	-	▲0.135
1Y	-	-	-	▲0.159

無担保コール(速報)は日銀、東京レポレートは日本証券協会公表

## 本日の市況

本日の無担保コールON物は▲0.030%の出合から始まり、その後は主に▲0.040%~▲0.020%の水準で出合が見られた。週末3日積み要因が剥落し地合いは若干弱含み、同加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.001%の▲0.030%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.040 ~ ▲0.035	▲0.035 ~ ▲0.035	▲0.040 ~ ▲0.020

## 翌営業日のマーケット

出合水準は、本日対比で概ね横ばいを想定。

## 資金需給

	日銀速報	日銀予想	当社需給予想
	11月2日	11月4日	11月5日
券	▲300	+800	+0
財政	▲37,000	▲13,100	▲36,000
過不足	▲37,300	▲12,300	▲36,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国債買入	+13,100		
共通担保(全店)	▲2,800	+1,600	
CP等買入	▲300	▲100	
ETF買入	+700		
国債補完供給	▲100	+100	
当座預金増減	▲25,100	▲12,300	▲36,000
当座預金残高	4,868,100	4,855,800	4,819,800
準備預金残高	4,272,300	主な需給要因	
積み終了先	4,272,300	普通交付税	
超過準備	4,272,300	税保険揚げ	
非準備先残高	595,800	国債発行(10年)	
準備預金進捗率	99.9%		
平均	61.3%		
乖離率	38.6%		

## 11月2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(11/2~11/4)	44	44	▲0.350	▲0.350		
	40	40	▲0.350	▲0.350		

## 国庫短期証券入札予定

11月6日	3ヶ月	第949回
11月9日	6ヶ月	第950回
11月13日	3ヶ月	
11月19日	1年	
11月4日	10年	
11月6日	物価運動	
11月10日	30年	
11月12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	1,000~2,000	1,000	月2回程度	10月30日	2
1年超3年以下	3,500~6,500	4,200	5 11 17 24 26	10月30日	5
3年超5年以下	2,500~6,000	3,500	5 11 17 24 30	10月30日	5
5年超10年以下	2,500~6,000	4,200	9 11 17 24 26	10月30日	5
10年超25年以下	500~2,000	1,200	9 26	10月26日	2
25年超	0~500	300	5 30	10月26日	2
物価運動債	300	300	月2回程度	10月21日	2
変動利付債<偶数月>	500	500	月1回	10月7日	-

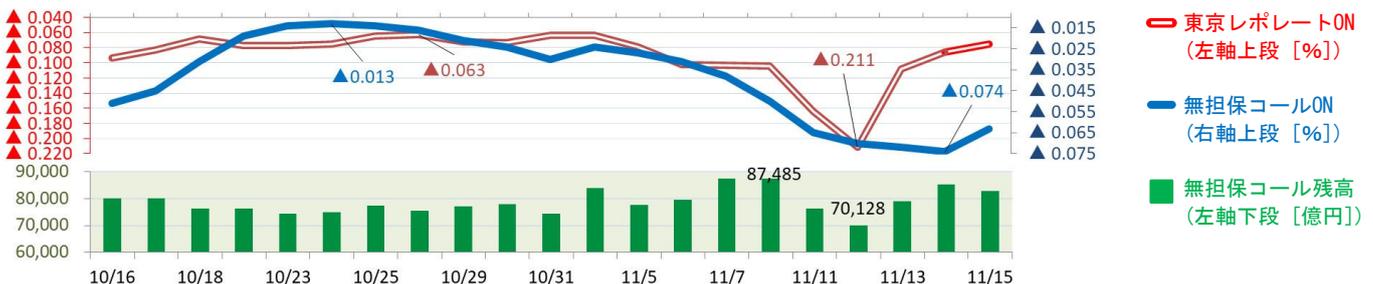
マナターベース [億円]  
10月30日時点 6,082,700

所要 [億円]  
今積期の所要準備額 3,537,500  
11月4日以降の残り所要  
積数 200  
平均 0

## 1年前の市場推移

○2019年10月積み期 [10月16日~11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(登号)第243号 加入協会 日本証券業協会