

短期市場の推移

	10月29日	10月30日	11月2日	11月4日
加重平均金利	▲0.026	▲0.029	▲0.030	▲0.032
東京レポレート(ON)	▲0.091	▲0.093	▲0.086	▲0.097
無コール残	108,529	114,430	120,001	106,368
ON	62,516	71,397	78,618	65,235
その他	46,013	43,033	41,383	41,133
有コール残	19,307	20,057	20,725	19,364

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6日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
		4:00	(米)11月連邦公開市場委員会(FOMC)政策金利 0.25%
		22:30	(米)10月非農業部門雇用者数 65.0万人
		22:30	(米)10月失業率 7.7%

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	▲0.065	0.001	▲0.031	▲0.094
T/N	▲0.050	▲0.001	▲0.034	▲0.102
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.035	▲0.020	▲0.023	▲0.096
2W	-	-	-	▲0.096
3W	-	-	-	▲0.097
1M	-	-	-	▲0.102
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.113
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業協会公表

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。同加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.001%の▲0.031%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.040 ~ ▲0.040	▲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5日	11月6日	11月9日
券	▲100	+300	+1,000
財政	▲20,800	+900	▲21,000
過不足	▲20,900	+1,200	▲20,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国庫短期証券買入		+15,000	
国債買入			+9,600
CP等買入	▲600	▲300	
社債等買入		▲100	+3,000
国債補完供給	+900	▲500	+500
当座預金増減	▲6,100	+10,900	▲17,000
当座預金残高	4,851,600	4,862,500	4,845,500
準備預金残高	4,249,200	主な需給要因	
積み終了先	4,249,100	国庫短期証券	
超過準備	4,249,100	発行・償還(3M)	
非準備先残高	602,400	物国発行(10年)	
準備預金進捗率	99.9%		
平均	67.7%		
乖離率	32.2%		

11月5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(11/6~)						
1~3年	5,000	8,979	5,001	▲0.010	▲0.007	76.3
3~5年	4,200	10,189	4,204	▲0.014	▲0.013	69.4
25年~	300	1,191	303	▲0.019	▲0.018	35.6
社債等買入(11/9~)	3,000	6,969	3,001	▲0.034	▲0.028	18.1
国債補完供給(11/5~11/6)	487	487	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マナタリーベース [億円]
11月4日時点 6,046,700

所要 [億円]
今積期の所要準備額 3,537,500
11月6日以降の残り所要積数 100
平均 0

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6日	物価連動	
11月10日	30年	
11月12日	5年	
11月18日	20年	

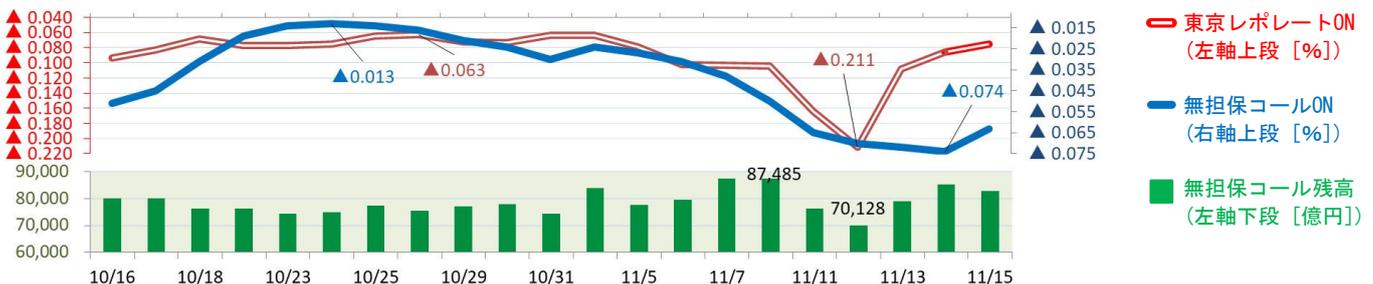
今月の国債買入オペ予定

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	5,000	5 11 17 24 26	11月5日	4
3年超5年以下	2,500~6,000	4,200	5 11 17 24 30	11月5日	4
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	11月5日	1
物価連動債	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	-

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