

DAILY SIGNAL 上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

2020年11月6日(金)

短期市場の推移

[億円][%]

	10月30日	11月2日	11月4日	11月5日
加重平均金利	▲0.029	▲0.030	▲0.032	▲0.031
東京レポレート(ON)	▲0.093	▲0.086	▲0.097	▲0.094
無コール残	114,430	120,001	106,368	107,788
ON	71,397	78,618	65,235	64,605
その他	43,033	41,383	41,133	43,183
有コール残	20,057	20,725	19,364	22,316

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9日の予定(時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
8:50 金融政策決定会合における主な意見(10月28・29日分)	-	(米)クオールズFRB副議長の議会証言	-
8:50 マネタリーベースと日本銀行の取引(10月)	-	(米)クリーブランド連銀総裁の講演	-
15:00 コール市場残高(10月)	-	-	-

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

本日の市況

	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	▲0.080	0.001	▲0.029	▲0.091
T/N	▲0.050	▲0.001	▲0.020	▲0.090
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.025	▲0.012	▲0.021	▲0.092
2W	-	-	-	▲0.094
3W	-	-	0.025	▲0.097
1M	-	-	-	▲0.101
2M	-	-	0.020	-
3M	-	-	-	▲0.112
6M	-	-	-	▲0.135
1Y	-	-	-	▲0.158

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

本日の無担保コールON物は▲0.025%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)は週末3日積み要因もあり、前営業日比+0.002%の▲0.029%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.045 ~ ▲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、週末3日積み要因の剥落から、本日対比で若干の下落を想定。

資金需給

[億円]

	日銀速報 11月6日	日銀予想 11月9日	当社需給予想 11月10日
券	+300	+700	+0
財政	▲1,300	▲20,500	▲19,000
過不足	▲1,000	▲19,800	▲19,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国債買入	+9,600	-	-
CP等買入	▲300	▲100	-
社債等買入	▲100	+3,000	-
国債補完供給	+500	▲700	+700
当座預金増減	+8,000	▲16,200	▲19,000
当座預金残高	4,859,600	4,843,400	4,824,400
準備預金残高	4,233,600	主な需給要因	
積み終了先	4,233,600	国庫短期証券発行・償還(3M)	
超過準備	4,233,600	国庫短期証券発行・償還(6M)	
非準備先残高	626,000	物国発行(10年)	
準備預金進捗率	99.9%	-	
平均	77.4%	-	
乖離率	22.5%	-	

11月6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(11/6~11/9)	493	493	▲0.350	▲0.350		
	186	186	▲0.350	▲0.350		

マネタリーベース [億円]
11月5日時点 6,040,700

所要 [億円]
今積期の所要準備額 3,545,200
11月9日以降の残り所要積数 100
平均 0

国庫短期証券入札予定

今月の国債買入オペ予定

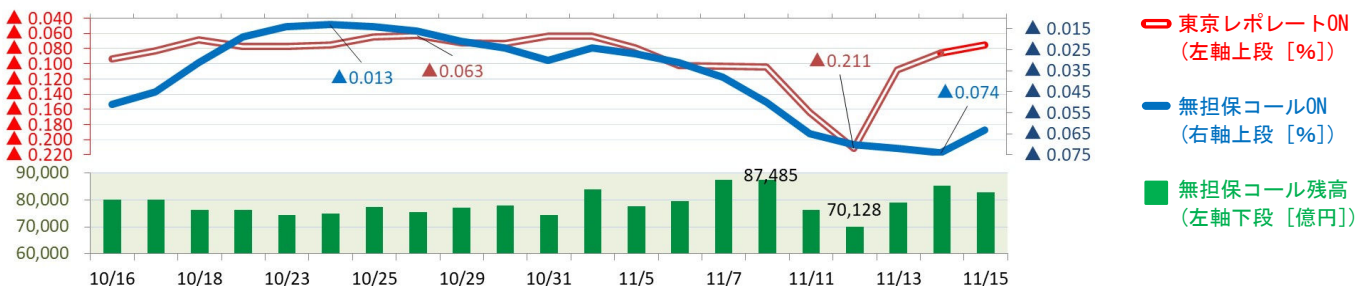
11月9日 6ヶ月 第950回
11月13日 3ヶ月 第951回
11月19日 1年
11月20日 3ヶ月
国債入札予定
11月10日 30年
11月12日 5年
11月18日 20年
11月25日 40年

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