

DAILY SIGNAL

上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

2019年11月5日(火)

短期市場の推移

[億円] [%]

	10月29日	10月30日	10月31日	11月1日
加重平均金利	▲0.021	▲0.024	▲0.030	▲0.024
東京レポレート(ON)	▲0.072	▲0.073	▲0.064	▲0.064
無コール残	77,200	77,828	74,425	83,920
ON	51,675	53,053	53,760	60,905
その他	25,525	24,775	20,665	23,015
有コール残	19,553	19,831	19,814	19,851

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。

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	▲0.027	▲0.079
T/N	-	-	▲0.035	▲0.071
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.025	▲0.005	▲0.018	▲0.071
2W	-	-	-	▲0.073
3W	-	-	-	▲0.077
1M	-	-	-	▲0.081
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.124
6M	-	-	-	▲0.168
1Y	-	-	-	▲0.192

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

11月6日の予定(時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
8:50	政策委員会・金融政策 決定会合議事要旨 (9月18・19日分)	-	21:00	(米)MBA住宅ローン申請 指数[前週比]
	-	-		NY連銀総裁の講演
	-	-		-

経済指標及び予想値は株式会社フィスコ提供

本日の市況

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▲0.035%~▲0.025%の水準で取引された。
なお一巡後は調整で▲0.035%の出合も見られた。
同加重平均金利(速報)は前日対比▲0.003%の▲0.027%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.035 ~ ▲0.035	▲0.025 ~ ▲0.020	▲0.035 ~ ▲0.025

翌営業日のマーケット

出合水準の中心は▲0.040%~▲0.020%になると予想。

資金需給

[億円]

	日銀速報	日銀予想	当社需給予想
	11月5日	11月6日	11月7日
券	+600	+900	+1,000
財政	▲7,400	▲700	▲24,000
過不足	▲6,800	+200	▲23,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国債買入	▲4,100	▲9,200	スタート
共通担保(全店)	▲3,600		
CP等買入	▲100		
国債補完供給	▲200	+200	
当座預金増減	▲4,900	+9,600	▲23,000
当座預金残高	4,071,600	4,081,200	4,058,200
準備預金残高	3,537,700	主な需給要因	
積み終了先	3,537,500	国債発行(10年)	
超過準備	3,537,400		
非準備先残高	533,900		
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 [%][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	按分
国債買入(11/6~)						
1~3年	4,200	9,471	4,209	0.020	0.021	24.4
3~5年	3,400	9,329	3,406	0.023	0.025	24.0
10~25年	1,000	4,153	1,005	0.033	0.033	49.8
25年~	300	1,002	304	0.026	0.026	56.9
米ドル資金供給(11/7~11/15)						
		1	1	2.080	2.080	
国債補完供給(11/5~11/6)						
		206	206	▲0.350	▲0.350	

マネタリーベース [億円]
11月1日時点 5,201,500

所要 [億円]
今積期の所要準備額 3,193,600
11月6日以降の残り所要
積数 1,900
平均 200

国庫短期証券入札予定

11月7日 6ヶ月 第868回
11月8日 3ヶ月 第869回
11月15日 3ヶ月
11月19日 1年
国債入札予定
11月6日 10年
11月8日 物価運動
11月12日 30年
11月14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	4,200	月2回程度	10月21日	2
1年超3年以下	3,000~5,500 程度	5,200			
3年超5年以下	2,000~4,500 程度	3,400	5 11 19 25	11月5日	3
5年超10年以下	2,000~5,000 程度	3,500	1 11 19 27	11月1日	3
10年超25年以下	500~2,000 程度	1,000			
25年超	0~500 程度	300	5 15 25	11月5日	2
物価運動債	300 程度	300	月2回程度	11月1日	1
変動利付債<偶数月>	1,000 程度	1,000	-	10月15日	-

1年前の市場推移

○2018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