

DAILY SIGNAL 上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

2019年11月6日(水)

短期市場の推移

[億円][%]

	10月30日	10月31日	11月1日	11月5日
加重平均金利	▲0.024	▲0.030	▲0.024	▲0.027
東京レポレート(ON)	▲0.073	▲0.064	▲0.064	▲0.079
無コール残	77,828	74,425	83,920	77,597
ON	53,053	53,760	60,905	53,577
その他	24,775	20,665	23,015	24,020
有コール残	19,831	19,814	19,851	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。

11月7日の予定(時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
8:50 預金種類別店頭表示金利の平均年利率等	-	21:00 (英)11月英中銀(BOE)政策金利	0.75%
-	-	22:30 (米)新規失業保険申請件数[前週分]	-
-	-	(米)ダラス連銀総裁の講演	-

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	▲0.031	▲0.102
T/N	▲0.050	▲0.035	▲0.040	▲0.096
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	▲0.025	▲0.088
2W	▲0.020	▲0.001	▲0.019	▲0.090
3W	-	-	-	▲0.093
1M	-	-	▲0.020	▲0.097
2M	-	-	-	-
3M	-	-	0.060	▲0.124
6M	-	-	-	▲0.167
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

本日の無担保コールON物は▲0.035%の出合から始まり、その後は主に▲0.040%~▲0.025%の水準で取引された。同加重平均金利(速報)は前日対比▲0.004%の▲0.031%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.040 ~ ▲0.040	▲0.025 ~ ▲0.025	▲0.035 ~ ▲0.020

翌営業日のマーケット

本日よりも調達意欲がやや弱まり、出合いの水準は小幅低下を予想。

資金需給

[億円]

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想
	11月6日	11月7日	11月7日	11月8日	11月8日
券	+1,000	▲100	▲100	+1,000	+1,000
財政	▲1,600	▲20,500	▲20,500	+2,000	+2,000
過不足	▲600	▲20,600	▲20,600	+3,000	+3,000
金融調節	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド
国庫短期証券買入				+1,000	スタート
国債買入		+9,200			
国債補完供給	+200				
当座預金増減	+8,800	▲19,600	▲19,600	+3,000	+3,000
当座預金残高	4,080,400	4,060,800	4,060,800	4,063,800	4,063,800
準備預金残高	3,535,200				
積み終了先	3,534,900				
超過準備	3,534,900				
非準備預金残高	545,200				
準備預金進捗率	99.9%				
平均	71.0%				
乖離率	28.9%				

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
国庫短期証券買入(11/7~)	1,000	8,157	1,000	0.031	0.040	49.1
国債補完供給(11/6~11/7)	13	13	▲0.350	▲0.350		
	17	17	▲0.350	▲0.350		

マナタリーベース [億円]
11月5日時点 5,196,000

所要 [億円]
今積期の所要準備額 3,193,600
11月7日以降の残り所要積数 1,600
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	
11月8日	物価連動	
11月12日	30年	
11月14日	5年	
11月20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	100~1,000 程度	500	月2回程度	10月21日	2
1年超3年以下	3,000~5,500 程度	4,200			
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
物価連動債	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(登号)第243号 加入協会 日本証券業協会