

DAILY SIGNAL 上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

2019年11月8日(金)

短期市場の推移

	11月1日	11月5日	11月6日	11月7日
加重平均金利	▲0.024	▲0.027	▲0.031	▲0.038
東京レポレート(ON)	▲0.064	▲0.079	▲0.102	▲0.103
無コール残	83,920	77,597	79,599	87,464
ON	60,905	53,577	56,604	63,944
その他	23,015	24,020	22,995	23,520
有コール残	19,851	19,851	18,331	18,756

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11日の予定(時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
8:50	9月コア機械受注[前月比]	+0.9%	-	-
8:50	9月国際収支(経常収支)	17,100億円	-	-
8:50	金融政策決定会合における 主な意見(10月30・31日分)	-	-	-

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	▲0.087	0.001	▲0.050	▲0.104
T/N	-	-	▲0.035	▲0.111
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.040	▲0.020	▲0.026	▲0.105
2W	-	-	▲0.010	▲0.102
3W	-	-	-	▲0.103
1M	-	-	-	▲0.106
2M	-	-	▲0.025	-
3M	-	-	-	▲0.123
6M	-	-	-	▲0.167
1Y	-	-	-	▲0.190

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▲0.050%の出合から始まり、その後は主に▲0.087%~▲0.030%の水準で取引された。週末3日積みではあったものの、ビッドサイドの調達意欲が弱く、同加重平均金利(速報)は前日対比▲0.012%の▲0.050%と4営業日連続で低下した。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.087 ~ ▲0.080	▲0.080 ~ ▲0.050	▲0.080 ~ ▲0.030

翌営業日のマーケット

引き続きビッドサイドの調達意欲は弱く、軟調な地合を予想。

資金需給

	日銀速報	日銀予想	当社需給予想
	11月8日	11月11日	11月12日
券	+500	+1,100	+1,000
財政	+2,000	▲14,400	▲1,000
過不足	+2,500	▲13,300	+0
金融調節	エンド	スタート	エンド
共通担保(全店)	▲300	▲5,600	▲4,500
CP等買入		▲100	
国債補完供給	▲200	+200	
当座預金増減	+2,000	▲14,300	+0
当座預金残高	4,061,800	4,047,500	4,047,500
準備預金残高	3,519,000	主な需給要因	
積み終了先	3,518,800	国庫短期証券	
超過準備	3,518,800	発行・償還(3M・6M)	
非準備預金残高	542,800	国債発行	
準備預金進捗率	99.9%	(10年物価連動債)	
平均	83.9%		
乖離率	16.0%		

11月8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(11/8~11/11)	131	131	▲0.350	▲0.350		
	100	100	▲0.350	▲0.350		
共通担保(全店)(11/11~11/25)	15,000	4,526	4,526			

マナタリーベース [億円]
11月7日時点 5,183,200

所要 [億円]
今積期の所要準備額 3,197,900
11月11日以降の残り所要
積数 700
平均 100

国庫短期証券入札予定

11月15日	3ヶ月	第870回
11月19日	1年	
11月22日	3ヶ月	
11月29日	3ヶ月	
11月12日	30年	
11月14日	5年	
11月20日	20年	
11月26日	40年	

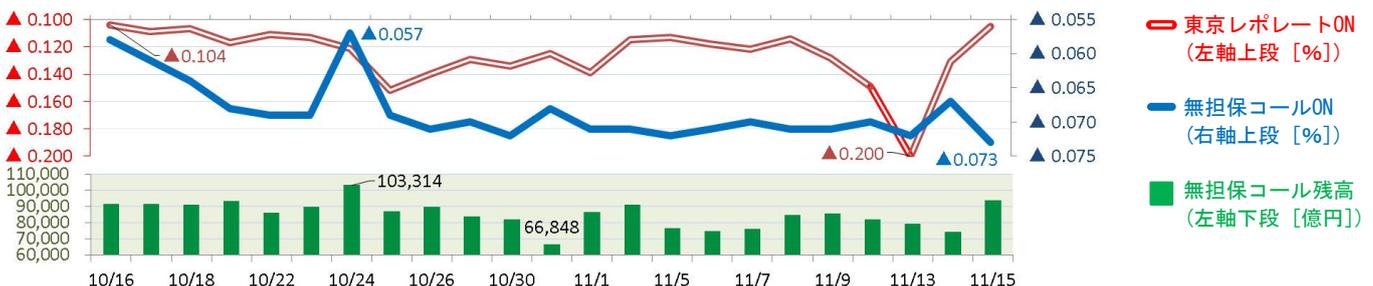
今月の国債買入オペ予定

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