

DAILY SIGNAL 上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

2020年12月2日(水)

短期市場の推移

	11月26日	11月27日	11月30日	12月1日
加重平均金利	▲0.030	▲0.030	▲0.032	▲0.030
東京レポレート(ON)	▲0.078	▲0.079	▲0.077	▲0.076
無コール残	106,857	120,085	100,290	99,557
ON	65,459	79,647	60,852	60,849
その他	41,398	40,438	39,438	38,708
有コール残	21,699	20,784	19,423	20,494

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。

12月3日の予定 (時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
8:50	日銀当座預金増減要因 (12月見込み)	-	22:30	(米)新規失業保険申請件数 [前週分]	-
	-			-	
	-			-	

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	▲0.075	0.010	▲0.029	▲0.077
T/N	▲0.020	▲0.001	▲0.007	▲0.079
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.028	▲0.018	▲0.022	▲0.082
2W	▲0.045	▲0.010	▲0.020	▲0.085
3W	▲0.045	0.030	0.007	▲0.089
1M	-	-	-	▲0.101
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.107
6M	-	-	-	▲0.131
1Y	-	-	-	▲0.155

無担保コール(速報)は日銀、東京レポレートは日本証券協会公表

本日の市況

本日の無担保コールON物は▲0.020%の出合から始まり、その後は主に▲0.050%~▲0.015%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▲0.029%となった。

都銀・信託		証券	地銀
▲0.055 ~ ▲0.045		▲0.025 ~ ▲0.020	▲0.050 ~ ▲0.015

翌営業日のマーケット

調達サイドの動向に大きな変化はなく、本日と同水準での出合を予想する。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	12月2日	12月3日	12月3日	12月4日	12月4日	12月5日
券	▲1,200	▲2,000	▲2,000	▲2,000	▲2,000	▲2,000
財政	▲96,600	+10,400	+10,400	+8,000	+8,000	+8,000
過不足	▲97,800	+8,400	+8,400	+10,000	+10,000	+10,000
金融調節	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド	スタート
国庫短期証券買入		+30,000				
国債買入				+10,800		
共通担保(全店)	▲1,400	+1,900				
CP等買入	▲200		▲300			
社債等買入			▲100			
国債補完供給	+300					
成長基盤強化支援	▲6,700	+1,700				
当座預金増減	▲72,200	+18,800	+18,800	▲10,000	▲10,000	▲10,000
当座預金残高	4,766,300	4,785,100	4,785,100	4,775,100	4,775,100	4,775,100
準備預金残高	4,197,600	主な需給要因				
積み終了先	4,197,600					
超過準備	4,197,600					
非準備先残高	568,700					
準備預金進捗率	99.9%					
平均	56.7%					
乖離率	43.2%					

12月2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(12/3~)						
~1年	1,500	3,032	1,505	0.002	0.006	9.5
1~3年	5,000	12,760	5,009	0.002	0.003	85.1
3~5年	4,200	11,869	4,204	0.003	0.005	23.9
CP等買入(12/7~)	6,000	10,834	5,994	▲0.039	▲0.031	30.5
国債補完供給(12/2~12/3)						
	47		47	▲0.350	▲0.350	
	0		0			

マナタリーベース [億円]
12月1日時点 6,030,200

所要 [億円]
今積期の所要準備額 3,451,500
12月3日以降の残り所要積数 200
平均 0

国庫短期証券入札予定

12月4日	3ヶ月	第956回
12月9日	6ヶ月	第957回
12月11日	3ヶ月	
12月15日	6ヶ月	
12月3日	30年	
12月8日	5年	
12月10日	20年	
12月24日	2年	

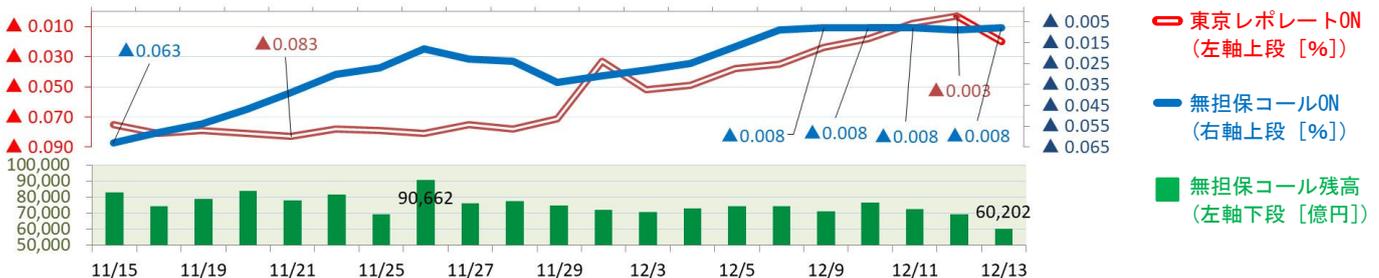
今月の国債買入オペ予定

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	1,500	月2回程度	12月2日	1
1年超3年以下	3,500~6,500	5,000	2 7 11 16 21	12月2日	4
3年超5年以下	2,500~6,000	4,200	2 11 16 21 25	12月2日	4
5年超10年以下	2,500~6,000	4,200	4 11 16 21 25	11月26日	5
10年超25年以下	500~2,000	1,200	4 25	11月26日	2
25年超	0~500	300	7 25	11月30日	2
物価連動債	300	300	月2回程度	11月26日	2
変動利付債<偶数月>	500	500	月1回	10月7日	1

1年前の市場推移

○2019年11月積み期 [11月15日~12月13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