

DAILY SIGNAL 上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

2020年12月3日(木)

短期市場の推移

[億円] [%]

	11月27日	11月30日	12月1日	12月2日
加重平均金利	▲0.030	▲0.032	▲0.030	▲0.029
東京レポレート(ON)	▲0.079	▲0.077	▲0.076	▲0.077
無コール残	120,085	100,290	99,557	102,258
ON	79,647	60,852	60,849	63,935
その他	40,438	39,438	38,708	38,323
有コール残	20,784	19,423	20,494	21,321

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4日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	0:00 (米)11月ISM非製造業景況指数	56.0
-	-	22:30 (米)11月非農業部門雇用者数	50.0万人
-	-	22:30 (米)11月失業率	6.8%

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	▲0.075	0.001	▲0.030	▲0.076
T/N	▲0.020	▲0.001	▲0.008	▲0.080
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.020	▲0.018	▲0.019	▲0.082
2W	▲0.020	▲0.010	▲0.018	▲0.084
3W	-	-	-	▲0.089
1M	-	-	-	▲0.100
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.106
6M	-	-	-	▲0.130
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▲0.030%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.050 ~ ▲0.045	▲0.035 ~ ▲0.010	▲0.045 ~ ▲0.015

翌営業日のマーケット

3日積みということもあり、出合水準はやや上昇すると予想

資金需給

[億円]

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	12月3日	12月4日	12月4日	12月7日	12月7日	12月7日
券	▲2,000	▲1,200	▲2,000	▲2,000	▲2,000	▲2,000
財政	+9,100	▲8,400	▲8,400	▲4,000	▲4,000	▲4,000
過不足	+7,100	▲9,600	▲9,600	▲6,000	▲6,000	▲6,000
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
国債買入	+10,800	-	-	-	-	-
CP等買入	▲300	▲100	▲100	▲100	▲100	+6,000
社債等買入	▲100	-	-	-	-	-
国債補完供給	▲400	+400	+400	-	-	-
当座預金増減	+17,100	▲9,300	▲9,300	+0	+0	+0
当座預金残高	4,783,400	4,774,100	4,774,100	4,774,100	4,774,100	4,774,100
準備預金残高	4,200,900	4,200,900	4,200,900	4,200,900	4,200,900	4,200,900
積み終了先	4,200,800	4,200,800	4,200,800	4,200,800	4,200,800	4,200,800
超過準備	4,200,800	4,200,800	4,200,800	4,200,800	4,200,800	4,200,800
非準預先残高	582,500	582,500	582,500	582,500	582,500	582,500
準備預金進捗率	99.9%	99.9%	99.9%	99.9%	99.9%	99.9%
平均	60.0%	60.0%	60.0%	60.0%	60.0%	60.0%
乖離率	39.9%	39.9%	39.9%	39.9%	39.9%	39.9%

12月3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(12/3~12/4)	345	345	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マネタリーベース [億円]
12月2日時点 5,959,200

所要 [億円]
今積期の所要準備額 3,451,500
12月4日以降の残り所要積数 200
平均 0

国庫短期証券入札予定

今月の国債買入オペ予定

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8日	5年	
12月10日	20年	
12月24日	2年	
1月6日	10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	1,500	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