

2020年12月9日(水)

短期市場の推移

[億円][%]

12月3日		12月4日		12月7日		12月8日	
加重平均金利	▲0.030	▲0.030	▲0.028	▲0.028			
東京レシート(ON)	▲0.076	▲0.077	▲0.077	▲0.084			
無コール残	111,523	126,756	101,734	102,456			
ON	70,650	85,863	60,491	62,263			
その他	40,873	40,893	41,243	40,193			
有コール残	20,513	20,503	19,606	20,990			

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。

12月10日の予定（時刻は日本時間）

日本			海外		
		予想			予想
	-			(欧)12月欧中銀(ECB) 政策金利	
	-			-	
	-			-	

経済指標及び予想値は株式会社フィスコ提供

今日の短期市場金利

[%]

	無担保コール(速報)			レボ市場
	最低	最高	平均	東京レボレート
O/N	▲0.075	0.001	▲0.032	▲0.084
T/N	▲0.050	▲0.001	▲0.012	▲0.088
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.050	▲0.015	▲0.022	▲0.086
2W	-	-	0.010	▲0.087
3W	▲0.025	▲0.020	▲0.021	▲0.092
1M	-	-	-	▲0.101
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.107
6M	-	-	-	▲0.128
1Y	-	-	-	▲0.152

無担保コール(連報)は日銀、東京レポ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▲0.020%の出合から始まり、その後は主に▲0.045%～▲0.015%の水準で出合が見られた。積み期終盤に差し掛かり調達量を減らす地銀業態も出てきたため、同加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.004%の▲0.032%となった。また、日銀は当座預金のマクロ加算残高にかかる基準比率を見直し、12月積み期間は17.5%(前回15.0%)とした。

都銀・信託	証券	地銀
▲ 0.045 ~ ▲ 0.040	▲ 0.025 ~ ▲ 0.015	▲ 0.040 ~ ▲ 0.015

翌営業日のマーケット

出合いの水準は本日対比横ばい圏を想定。

資金需給

[億円]

日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
12月9日		12月10日		12月11日	
券	▲1,000		▲2,300		▲3,000
財政	▲25,600		▲31,000		+6,000
過不足	▲26,600		▲33,300		+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	+25,000				
CP等買入	▲600		▲300		
社債等買入	▲100			+3,000	
ETF買入	+600				
国債補完供給	+100	▲100	+100		
当座預金増減	▲1,700		▲30,500		+3,000
当座預金残高	4,800,700		4,770,200		4,773,200
準備預金残高	4,191,700	主な需給要因			
積み終了先	4,191,600	国庫短期証券 発行・償還(6M)			
超過準備	4,191,600				
非準備先残高	609,000				
準備預金進捗率	99.9%	国債発行(20年)			
平均	80.0%				
乖離率	19.9%				

12月9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

国債補完供給(12/9~12/10)	106 0	106 0	▲0.350	▲0.350
--------------------	----------	----------	--------	--------

マネタリーベース [億円]
12月8日時点 6,000,400

所要	[億円]
今積期の所要準備額	3,459,500
12月10日以降の残り所要	
積数	100
平均	0

国庫短期証券入札予定

12月11日	3ヶ月	第958回
12月15日	6ヶ月	第959回
12月16日	1年	第960回
12月17日	3ヶ月	
国債入札予定		
12月10日	20年	
12月24日	2年	
1月6日	10年	
1月8日	30年	

今月の国債買入才へ予定

オファー種類	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7日	3
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	12月4日	4
10年超25年以下	500~2,000	1,200	4 25	12月4日	1
25年超	0~500	300	7 25	12月7日	1
物価運動債	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	12月7日	0

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、いかなる投資のアドバイス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、完全性の保証するものではなく、今後予告なく変更することがあります。

上田八矩資産株式会社 登録金融機関 近畿財務局(券)第 243号 加川金 日本証券業協会

上田八木短資株式会社 登録金融機関 近畿財務局長(資金)第243号 加入協会 日本証券業協会