

DAILY SIGNAL 上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

2020年12月10日(木)

短期市場の推移

	12月4日	12月7日	12月8日	12月9日
加重平均金利	▲0.030	▲0.028	▲0.028	▲0.032
東京レポレート(ON)	▲0.077	▲0.077	▲0.084	▲0.084
無コール残	126,756	101,734	102,456	124,594
ON	85,863	60,491	62,263	82,796
その他	40,893	41,243	40,193	41,798
有コール残	20,503	19,606	20,990	20,490

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11日の予定(時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
国債市場特別参加者会合		22:30	(米)11月生産者物価コア指数[前年比] 1.5%
-			ケールズFRB副議長の講演
-			-

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

	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	▲0.032	▲0.082
T/N	▲0.050	▲0.001	▲0.030	▲0.086
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.025	▲0.015	▲0.020	▲0.086
2W	▲0.040	0.001	▲0.021	▲0.086
3W	-	-	-	▲0.095
1M	-	-	▲0.040	▲0.102
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.107
6M	-	-	-	▲0.127
1Y	-	-	-	▲0.152

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▲0.020%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。
同加重平均金利(速報)は前営業日横這いの▲0.032%となった。

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

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	12月10日	12月11日	12月11日	12月12日	12月14日	12月15日
券	▲2,300	▲1,400	▲1,400	▲1,000	▲1,000	▲1,000
財政	▲29,500	▲600	▲600	▲17,000	▲17,000	▲17,000
過不足	▲31,800	▲2,000	▲2,000	▲18,000	▲18,000	▲18,000
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
CP等買入	▲300	▲900	▲900	▲100	▲100	▲100
社債等買入		+3,000	+3,000			
ETF買入						
国債補完供給	+100	▲300	+300			
当座預金増減	▲29,300	▲2,600	▲2,600	▲18,000	▲18,000	▲18,000
当座預金残高	4,771,400	4,768,800	4,768,800	4,750,800	4,750,800	4,750,800
準備預金残高	4,162,900	4,162,900	4,162,900	4,162,900	4,162,900	4,162,900
積み終了先	4,162,900	4,162,900	4,162,900	4,162,900	4,162,900	4,162,900
超過準備	4,162,900	4,162,900	4,162,900	4,162,900	4,162,900	4,162,900
非準備先残高	608,500	608,500	608,500	608,500	608,500	608,500
準備預金進捗率	100.0%	100.0%	100.0%	100.0%	100.0%	100.0%
平均	83.3%	83.3%	83.3%	83.3%	83.3%	83.3%
乖離率	16.7%	16.7%	16.7%	16.7%	16.7%	16.7%

12月10日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	接分
国債補完供給(12/10~12/11)	217	217	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マナタリーベース [億円]
12月9日時点 5,999,700

所要 [億円]
今積期の所要準備額 3,459,500
12月11日以降の残り所要積数 0
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	第961回
12月24日	2年	
1月6日	10年	
1月8日	30年	
1月13日	5年	

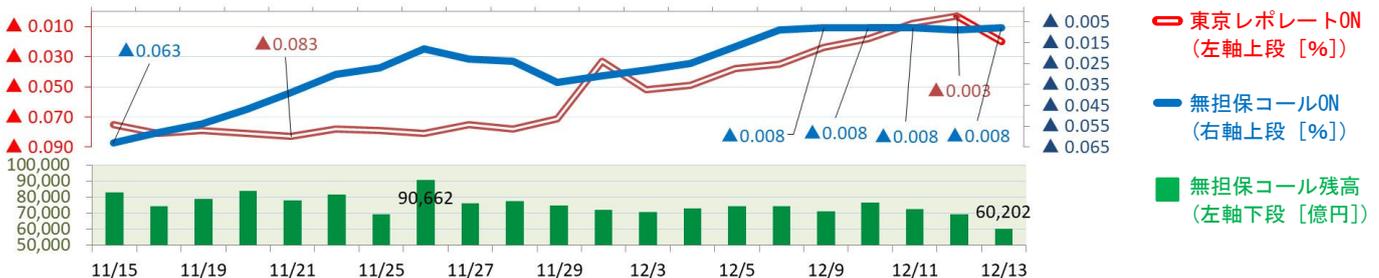
今月の国債買入オペ予定

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	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(登金)第243号 加入協会 日本証券業協会