

DAILY SIGNAL

上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

2020年12月11日(金)

短期市場の推移

[億円] [%]

	12月7日	12月8日	12月9日	12月10日
加重平均金利	▲0.028	▲0.028	▲0.032	▲0.032
東京レポレート(ON)	▲0.077	▲0.084	▲0.084	▲0.082
無コール残	101,734	102,456	124,594	120,310
ON	60,491	62,263	82,796	77,592
その他	41,243	40,193	41,798	42,718
有コール残	19,606	20,990	20,490	20,755

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14日の予定(時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
8:50 10-12月期日銀短観(大企業製造業DI)	-16	19:00 (欧)10月鉱工業生産指数[前月比]	1.8%
10:00 日銀営業毎旬報告(12月10日現在)	-	-	-
-	-	-	-

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 東京レポ レート
	最低	最高	平均	
O/N	▲0.080	0.001	▲0.030	▲0.081
T/N	▲0.050	0.000	▲0.003	▲0.077
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.020	▲0.018	▲0.019	▲0.082
2W	-	-	▲0.003	▲0.085
3W	-	-	-	▲0.096
1M	-	-	-	▲0.100
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.104
6M	-	-	-	▲0.127
1Y	-	-	-	▲0.150

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▲0.040%～▲0.018%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+0.002%の▲0.030%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.040 ~ ▲0.040	▲0.025 ~ ▲0.025	▲0.040 ~ ▲0.018

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

[億円]

	日銀速報	日銀予想	当社需給予想
	12月11日	12月14日	12月15日
券	▲1,500	▲1,200	▲2,000
財政	▲1,100	▲13,200	+75,000
過不足	▲2,600	▲14,400	+73,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国債買入		+13,900	スタート
CP等買入	▲900	▲700	
社債等買入	▲100		
ETF買入	+100		
国債補完供給	+300	+200	
貸出増加支援			▲54,000 +54,700
当座預金増減	▲3,400	▲1,000	+73,700
当座預金残高	4,768,000	4,767,000	4,840,700
準備預金残高	4,180,500		
積み終了先	4,180,500		
超過準備	4,180,500		
非準預先残高	587,500		
準備預金進捗率	100.0%		
平均	93.3%		
乖離率	6.7%		

12月11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
国債買入(12/14~)						
1~3年	5,000	11,669	5,003	▲0.001	0.001	63.5
3~5年	4,200	7,027	4,201	▲0.009	▲0.004	54.8
5~10年	4,200	8,546	4,207	▲0.003	▲0.002	79.5
物価連動	300	1,681	300	▲0.070	▲0.178	
国債補完供給(12/11~12/14)						
		212	212	▲0.350	▲0.350	
		0	0			

マネタリーベース [億円]
12月10日時点 5,972,800

所要 [億円]
今積期の所要準備額 3,459,500
12月14日以降の残リ所要
積数 0
平均 0

国庫短期証券入札予定

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
1月5日 3ヶ月
国債入札予定
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11日	2
3年超5年以下	2,500~6,000	4,200	2 11 16 21 25	12月11日	3
5年超10年以下	2,500~6,000	4,200	4 11 16 21 25	12月11日	3
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	12月11日	1
変動利付債<偶数月>	500	500	月1回	12月7日	-

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