

# DAILY SIGNAL 上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

2020年12月14日(月)

## 短期市場の推移

	12月8日	12月9日	12月10日	12月11日
加重平均金利	▲0.028	▲0.032	▲0.032	▲0.030
東京レポレート(ON)	▲0.084	▲0.084	▲0.082	▲0.081
無コール残	102,456	124,594	120,310	121,711
ON	62,263	82,796	77,592	72,193
その他	40,193	41,798	42,718	49,518
有コール残	20,990	20,490	20,755	21,859

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15日の予定(時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
8:50 短観 (12月調査全容)	-	22:30 (米)12月ニューヨーク連銀 製造業景気指数	7.5
-	-	23:15 (米)11月鉱工業生産指数 [前月比]	0.3%
-	-	23:15 (米)11月設備稼働率	73.0%

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	▲0.028	▲0.070
T/N	▲0.050	0.000	▲0.003	▲0.077
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.020	0.030	▲0.010	▲0.083
2W	▲0.030	▲0.010	▲0.021	▲0.085
3W	-	-	-	▲0.098
1M	-	-	-	▲0.101
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.106
6M	-	-	-	▲0.126
1Y	-	-	-	▲0.151

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▲0.035%~▲0.020%の水準で出合が見られた。積み終盤に入り、大手行を中心としたビッドサイドの調達意欲は引き続き堅調であり、同加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.002%の▲0.028%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.035 ~ ▲0.030	-	▲0.035 ~ ▲0.020

## 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、引き続き堅調な地合を予想。

## 資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	12月14日	12月15日	12月14日	12月15日	12月16日	12月17日
券	▲1,200	▲1,800	▲1,200	▲1,800	▲2,000	▲2,000
財政	▲16,600	+75,300	▲16,600	+75,300	▲38,000	▲38,000
過不足	▲17,800	+73,500	▲17,800	+73,500	▲40,000	▲40,000
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				+25,000		
国債買入		+13,900				
共通担保(全店)					▲1,900	
CP等買入	▲700		▲1,100			
社債等買入			▲100			
国債補完供給	+200	▲1,300	+1,300			
貸出増加支援			▲49,000	+54,700		
当座預金増減	▲5,700	+104,300	▲5,700	+104,300	▲41,900	▲41,900
当座預金残高	4,762,300	4,866,600	4,762,300	4,866,600	4,824,700	4,824,700
準備預金残高	4,215,600		4,215,600			
積み終了先	4,215,600		4,215,600			
超過準備	4,215,600		4,215,600			
非準預先残高	546,700		546,700			
準備預金進捗率	100.0%		100.0%			
平均	96.7%		96.7%			
乖離率	3.3%		3.3%			

## 12月14日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	接分
国庫短期証券買入(12/15~)	25,000	31,417	25,002	▲0.010	▲0.003	40.9
CP等買入(12/17~)	6,000	10,524	5,999	▲0.039	▲0.011	24.1
国債補完供給(12/14~12/15)		1,300	1,300	▲0.350	▲0.350	
		2	2	▲0.350	▲0.350	

マナタリーベース [億円]  
12月11日時点 5,970,900

所要	所要準備額
今積期の所要準備額	3,459,500
12月15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	
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