

DAILY SIGNAL 上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

2020年12月16日(水)

短期市場の推移

	12月10日	12月11日	12月14日	12月15日
加重平均金利	▲0.032	▲0.030	▲0.028	▲0.023
東京レポレート(ON)	▲0.082	▲0.081	▲0.070	▲0.071
無コール残	120,310	121,711	113,169	110,663
ON	77,592	72,193	73,426	72,640
その他	42,718	49,518	39,743	38,023
有コール残	20,755	21,859	21,786	23,133

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17日の予定(時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
日銀金融政策決定会合(18日まで)		4:00 (米)12月連邦公開市場委員会(FOMC)政策金利	0.25%
-		21:00 (英)12月英中銀(BOE)政策金利	0.10%
-		22:30 (米)新規失業保険申請件数[前週分]	-

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	▲0.075	0.001	▲0.033	▲0.073
T/N	▲0.001	0.000	▲0.001	▲0.078
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.040	▲0.015	▲0.023	▲0.081
2W	▲0.035	▲0.010	▲0.021	▲0.089
3W	-	-	-	▲0.095
1M	-	-	▲0.005	▲0.098
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.104
6M	-	-	-	▲0.124
1Y	-	-	-	▲0.148

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▲0.025%の出合から始まった。その後は主に▲0.035%~▲0.020%の水準で出合が見られた。積み期初日ということから大手行を中心にビッドの水準が低下し、同加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.010%の▲0.033%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.070 ~ ▲0.060	▲0.020 ~ ▲0.020	▲0.050 ~ ▲0.020

翌営業日のマーケット

調達動向に大きな変化はなく、出合の水準は本日対比横ばいを予想する。

資金需給

	日銀速報	日銀予想	当社需給予想
	12月16日	12月17日	12月18日
券	▲2,100	▲2,700	▲3,000
財政	▲39,900	+2,500	+18,000
過不足	▲42,000	▲200	+15,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国債買入			+15,100
共通担保(全店)	▲1,900	+3,500	
CP等買入	▲100	▲500	+6,000
被災地金融機関支援			▲100
国債補完供給	+100	▲1,000	+1,000
当座預金増減	▲41,400	+21,400	+14,900
当座預金残高	4,826,800	4,848,200	4,863,100
準備預金残高	4,242,400	主な需給要因	
積み終了先	2,872,900		
超過準備	1,158,200		
非準備先残高	584,400		
準備預金進捗率	86.1%		
平均	3.2%		
乖離率	82.9%		

12月16日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	接分
国債買入(12/17~)						
~1年	1,500	2,717	1,501	0.006	0.011	79.9
1~3年	5,000	12,363	5,010	0.002	0.002	87.0
3~5年	4,200	13,813	4,204	0.000	0.000	75.0
5~10年	4,200	13,691	4,204	0.001	0.010	27.1
国債補完供給(12/16~12/17)						
		943	943	▲0.350	▲0.350	
		0	0			

マナターベース [億円]
12月15日時点 6,074,300

所要 [億円]
今積期の所要準備額 3,581,400
12月17日以降の残り所要
積数 497,200
平均 16,600

国庫短期証券入札予定

12月17日	3ヶ月	第961回
1月5日	3ヶ月	
1月7日	6ヶ月	
1月8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	

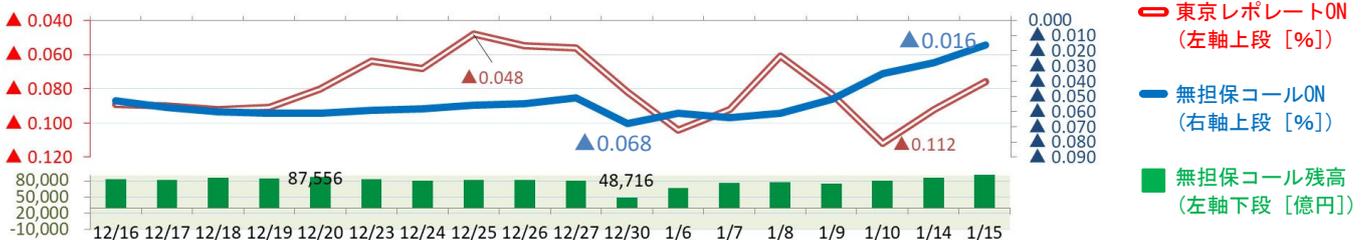
今月の国債買入オペ予定

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16日	0
1年超3年以下	3,500~6,500	5,000	2 7 11 16 21	12月16日	1
3年超5年以下	2,500~6,000	4,200	2 11 16 21 25	12月16日	2
5年超10年以下	2,500~6,000	4,200	4 11 16 21 25	12月16日	2
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	0

1年前の市場推移

○2019年12月積み期 [12月16日~1月15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