

DAILY SIGNAL 上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

2019年12月2日(月)

短期市場の推移

	11月26日	11月27日	11月28日	11月29日
加重平均金利	▲0.018	▲0.023	▲0.024	▲0.034
東京レポレート(ON)	▲0.081	▲0.075	▲0.078	▲0.071
無コール残	90,662	76,469	77,628	74,923
ON	62,647	49,954	51,173	51,308
その他	28,015	26,515	26,455	23,615
有コール残	19,622	20,282	20,609	22,072

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3日の予定(時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
8:50	マネタリーベース(11月)	-	0:00 (米)11月ISM製造業景況指数	49.5
10:00	営業毎旬報告(11月30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
	最低	最高	平均	東京レポレート
O/N	▲0.070	0.001	▲0.031	▲0.033
T/N	-	-	-	▲0.042
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.025	▲0.020	▲0.022	▲0.051
2W	▲0.028	0.000	▲0.016	▲0.054
3W	-	-	▲0.005	▲0.064
1M	-	-	-	▲0.114
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.120
6M	-	-	-	▲0.165
1Y	-	-	-	▲0.185

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▲0.03%の出合から始まった。その後は、主に▲0.035%~▲0.025%の水準で取引された。前営業日より強含む展開となり、同加重平均金利は前日対比+0.003%の▲0.031%(速報)となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.040 ~ ▲0.035	▲0.065 ~ ▲0.030	▲0.070 ~ ▲0.025

翌営業日のマーケット

地合いに大きな変化はなく横ばい圏での推移を予想。

資金需給

	日銀速報	日銀予想	当社需給予想
	12月2日	12月3日	12月4日
券	▲100	▲900	▲1,000
財政	▲28,200	▲23,600	▲91,000
過不足	▲28,300	▲24,500	▲92,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国債買入		+9,300	
CP等買入	▲100	▲200	
ETF買入		+500	
国債補完供給	+500	▲200	+200
成長基盤強化支援			▲9,400
			+10,300
当座預金増減	▲28,100	▲14,700	▲91,100
当座預金残高	4,018,500	4,003,800	3,912,700
準備預金残高	3,500,500	主な需給要因	
積み終了先	3,499,400		
超過準備	3,499,400		
非準備先残高	518,000	国債発行(10年)	
準備預金進捗率	99.9%	法人税・消費税	
平均	56.7%	保険揚げ	
乖離率	43.2%		

12月2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	接分
国債買入(12/3~)						
1~3年	4,200	9,622	4,204	0.007	0.010	17.5
3~5年	3,400	7,107	3,407	0.011	0.012	82.5
10~25年	1,000	4,817	1,013	0.018	0.018	77.8
25年~	300	988	302	0.004	0.005	58.1
国債補完供給(12/2~12/3)						
		172	172	▲0.250	▲0.250	

マネタリーベース [億円]
11月29日時点 5,173,300

所要 [億円]
今積期の所要準備額 3,111,500
12月3日以降の残り所要積数 4,200
平均 300

国庫短期証券入札予定

12月6日	3ヶ月	第874回
12月9日	6ヶ月	第875回
12月13日	3ヶ月	
12月18日	1年	
12月3日	10年	
12月5日	30年	
12月10日	5年	
12月17日	20年	

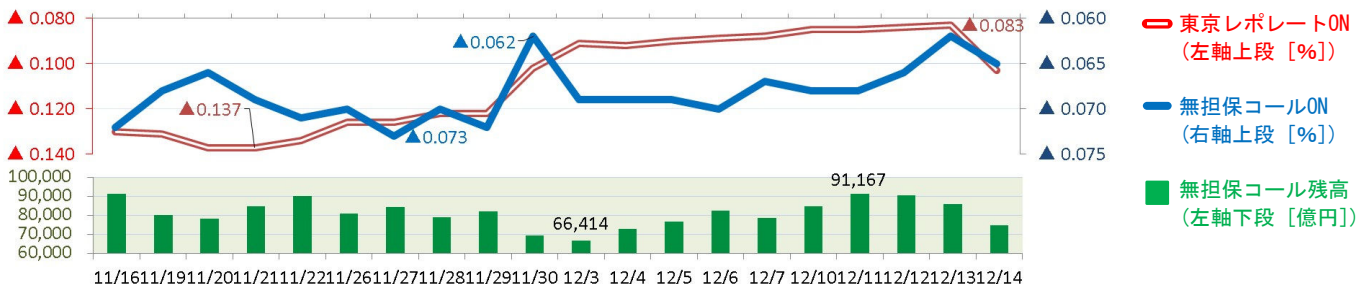
今月の国債買入オペ予定

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	100~1,000 程度	500	月2回程度	11月27日	2
1年超3年以下	3,000~5,500 程度	4,200			
3年超5年以下	2,000~4,500 程度	3,400	2 6 13 18	12月2日	3
5年超10年以下	2,000~5,000 程度	3,500	6 13 18 25	11月27日	4
10年超25年以下	500~1,500 程度	1,000			
25年超	0~500 程度	300	2 9 25	12月2日	2
物価連動債	300 程度	300	月2回程度	11月27日	2
変動利付債<偶数月>	1,000 程度	1,000	-	10月15日	-

1年前の市場推移

○2018年11月積み期 [11月16日~12月14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