

DAILY SIGNAL 上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

2019年12月5日(木)

短期市場の推移

	11月29日	12月2日	12月3日	12月4日
加重平均金利	▲0.034	▲0.031	▲0.028	▲0.025
東京レポレート(ON)	▲0.071	▲0.033	▲0.052	▲0.049
無コール残	74,923	71,960	71,011	72,947
ON	51,308	49,270	47,751	49,047
その他	23,615	22,690	23,260	23,900
有コール残	22,072	21,691	20,570	19,989

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6日の予定(時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
14:00頃	消費活動指数	22:30	(米)11月非農業部門雇用者数 19.0万人
15:00	コール市場残高(11月)	22:30	(米)11月失業率 3.6%
-	【記者会見】 原田審議委員(12月5日)	-	(米)ミシガン大消費者信頼感(速報)

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	▲0.055	0.001	▲0.017	▲0.038
T/N	-	-	-	▲0.032
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.010	0.000	▲0.007	▲0.043
2W	-	-	-	▲0.049
3W	-	-	-	▲0.064
1M	-	-	-	▲0.100
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.114
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▲0.020%の合いから始まった。その後は、主に▲0.025%~▲0.010%の水準で取引された。昨日よりも調達ニーズが一層強くなり、同加重平均金利は前日対比+0.008%の▲0.017%(速報)となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.025 ~ ▲0.025	▲0.020 ~ ▲0.010	▲0.020 ~ ▲0.010

翌営業日のマーケット

週末3日積みとなることから調達ニーズは強まり、出合いの水準は上昇と予想。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想
	12月5日	12月6日	12月6日	12月9日	12月9日
券	▲2,100	▲1,800	▲1,800	▲1,000	▲1,000
財政	+600	▲6,700	▲6,700	▲1,000	▲1,000
過不足	▲1,500	▲8,500	▲8,500	▲2,000	▲2,000
金融調節	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド
共通担保(全店)					▲6,200
CP等買入	▲500		▲300	+3,000	
社債等買入	▲100		▲100		
ETF買入				+600	
国債補完供給	+300	▲900	+900		
当座預金増減	▲2,700	▲4,400	▲4,400	▲8,200	▲8,200
当座預金残高	3,921,000	3,916,600	3,916,600	3,908,400	3,908,400
準備預金残高	3,410,500				
積み終了先	3,410,200				
超過準備	3,410,200				
非準備預金残高	510,500				
準備預金進捗率	99.9%				
平均	66.7%				
乖離率	33.2%				

12月5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(12/5~12/6)	357	357	▲0.250	▲0.250		
	511	511	▲0.250	▲0.250		

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10日	5年	
12月17日	20年	
12月24日	2年	
1月7日	10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	-

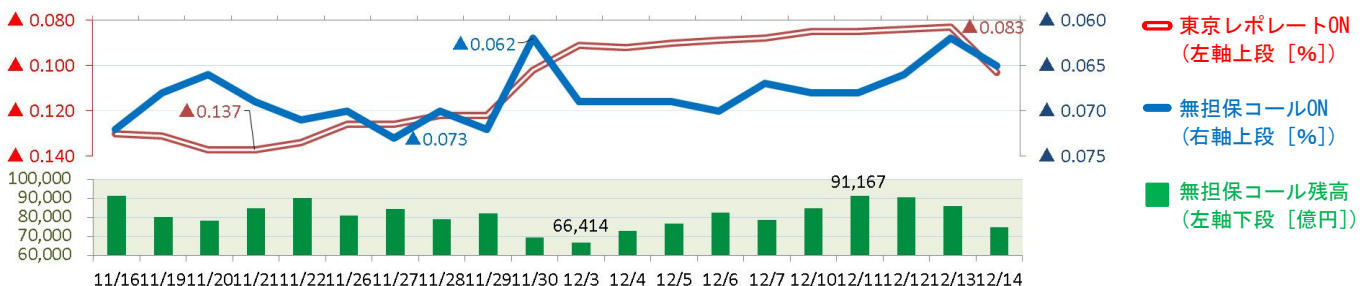
マナタリーベース [億円]
12月4日時点 5,052,200

所要 [億円]
今積期の所要準備額 3,111,500
12月6日以降の残り所要積数 2,300
平均 200

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