

DAILY SIGNAL 上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

2019年12月6日(金)

短期市場の推移

	12月2日	12月3日	12月4日	12月5日
加重平均金利	▲0.031	▲0.028	▲0.025	▲0.017
東京レポレート(ON)	▲0.033	▲0.052	▲0.049	▲0.038
無コール残	71,960	71,011	72,947	74,233
ON	49,270	47,751	49,047	50,188
その他	22,690	23,260	23,900	24,045
有コール残	21,691	20,570	19,989	19,996

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9日の予定(時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想	
8:50	国内総生産(GDP)改定値 [前期比年率]	+0.6%	16:00	(独)10月貿易収支	-
8:50	10月国際収支 (経常収支)	18104億円	16:00	(独)10月経常収支	-
8:50	国際収支状況 (10月速報)	-	-	-	-

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	▲0.045	0.001	▲0.009	▲0.035
T/N	-	-	-	▲0.032
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.002	0.000	▲0.001	▲0.039
2W	-	-	-	▲0.051
3W	-	-	-	▲0.066
1M	-	-	-	▲0.095
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.111
6M	-	-	-	▲0.164
1Y	-	-	-	▲0.184

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▲0.010%の出合いから始まった。その後は、主に▲0.015%~▲0.005%の水準で取引された。同加重平均金利は前日対比+0.008%の▲0.009%(速報)と、2019年10月以来約2か月ぶりの高水準となった。日銀はTN(12/9~12/10)で共通担保資金供給オペを30,000億円オフアしたがる、応札はなかった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.015 ~ ▲0.010	▲0.015 ~ ▲0.010	▲0.010 ~ ▲0.005

翌営業日のマーケット

週明けも調達ニーズは強く、地合いは横ばいを予想。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	12月6日	12月9日	12月9日	12月10日	12月10日	12月10日
券	▲1,800	▲700	▲700	▲1,000	▲1,000	▲1,000
財政	▲6,000	▲2,700	▲2,700	▲5,000	▲5,000	▲5,000
過不足	▲7,800	▲3,400	▲3,400	▲6,000	▲6,000	▲6,000
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
国債買入				+11,900		
共通担保(全店)		▲6,200	▲6,200	+5,800		
CP等買入	▲300	+3,000	▲100			
社債等買入	▲100		▲300			
ETF買入		+600				
国債補完供給	+900	▲600	+600			
当座預金増減	▲4,300	+8,300	+8,300	▲6,000	▲6,000	▲6,000
当座預金残高	3,916,700	3,925,000	3,925,000	3,919,000	3,919,000	3,919,000
準備預金残高	3,399,300					
積み終了先	3,399,100					
超過準備	3,399,100					
非準預先残高	517,400					
準備預金進捗率	99.9%					
平均	76.7%					
乖離率	23.2%					

12月6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(12/9~)						
1~3年	4,200	10,182	4,204	0.012	0.014	71.3
3~5年	3,400	11,151	3,402	0.018	0.019	72.5
5~10年	3,500	8,979	3,503	0.018	0.019	82.0
物価連動	300	1,483	304	▲0.080	▲0.112	65.7
国債補完供給(12/6~12/9)						
共通担保(全店)(12/9~12/10)	30,000	0	0			
共通担保(全店)(12/9~12/27)	15,000	5,757	5,757			

マナタリーベース [億円]
12月5日時点 5,051,600

所要 [億円]
今積期の所要準備額 3,117,600
12月9日以降の残り所要積数 1,400
平均 200

国庫短期証券入札予定

12月9日	6ヶ月	第875回
12月13日	3ヶ月	第876回
12月18日	1年	
12月20日	3ヶ月	
12月10日	5年	
12月17日	20年	
12月24日	2年	
1月7日	10年	

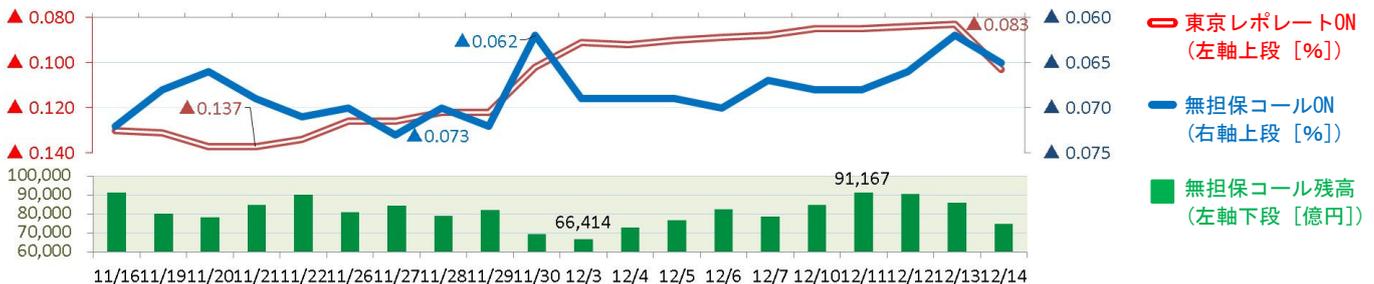
今月の国債買入オペ予定

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6日	2
5年超10年以下	2,000~5,000 程度	3,500	6 13 18 25	12月6日	3
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	12月6日	1
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。