DAILY SIGNAL

上田八木短資株式会社
TEL:0120-327-017

2019年12月10日(火)

短期市場の推移

[億円] [%]

	12月4日	12月5日	12月6日	12月9日
加重平均金利	▲0.025	▲0.017	▲0.009	▲0.008
東京レポレート(ON)	▲0.049	▲0.038	▲0.035	▲0.024
無コール残	72,947	74,233	74,411	71,372
ON	49,047	50,188	51,576	49,102
その他	23,900	24,045	22,835	22,270
有コール残	19,989	19,996	19,512	19,870

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11日の予定(時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
8:50	11月国内企業物価指数[前年比]	▲0.3%	21:00	(米)MBA住宅ローン申請指数[前週比]	-
	-		22:30	(米)11月消費者物価コア指数[前年比]	2.3%
	-				

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	▲0.008	▲0.018
T/N	-	-	-	▲0.017
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	▲0.010	▲0.032
2W	▲0.010	0.001	▲0.003	▲0.050
3W	-	-	-	▲0.086
1M	-	-	-	▲0.089
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.102
6M	-	-	-	▲0.158
1Y	-	-	-	▲0.181

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横ばいの▲0.008%(速報)となった。

[%]

都銀・信託	証券	地銀
▲ 0.015 ～ ▲ 0.010	▲ 0.008 ～ ▲0.008	▲ 0.010 ～ ▲ 0.005

翌営業日のマーケット

引き続きビッドサイドの調達ニーズは強く、地合いは横ばいを予想。

資金需給

[億円]

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	12月10日		12月11日		12月12日	
券		▲1,600		▲1,700		▲3,000
財政		▲6,900		▲23,100		▲4,000
過不足		▲8,500		▲24,800		▲7,000
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		+3,000				
CP等買入	▲500		▲300			
ETF買入		+200				
国債補完供給		▲200	+200			
当座預金増減		▲6,000		▲24,900		▲7,000
当座預金残高		3,920,300		3,895,400		3,888,400
準備預金残高		3,416,500	主な需給要因			
積み終了先		3,416,200				
超過準備		3,416,200				
非準預先残高		503,800	国債発行(5年)		源泉税揚げ	
準備預金進捗率		99.9%				
平均		83.3%				
乖離率		16.6%				

12月10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	按分
米ドル資金供給(12/12～12/19)		2	2	2.050	2.050	
国債補完供給(12/10～12/11)		92	92	▲0.250	▲0.250	
		110	110	▲0.250	▲0.250	

マネタリーベース [億円]

12月9日時点 5,059,500

所要

[億円]

今積期の所要準備額	3,117,600
12月11日以降の残り所要	
積数	1,000
平均	200

国庫短期証券入札予定

12月13日	3ヶ月	第876回
12月18日	1年	
12月20日	3ヶ月	
1月7日	3ヶ月	

国債入札予定

12月17日	20年
12月24日	2年
1月7日	10年
1月9日	30年

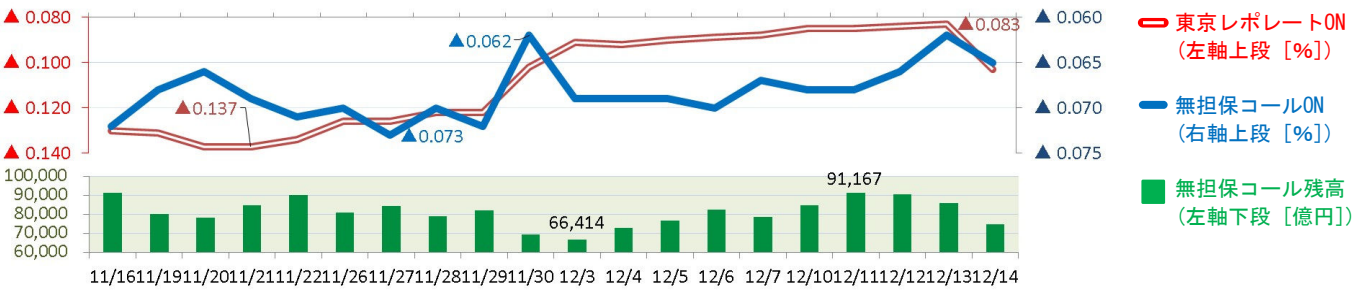
今月の国債買入オペ予定

[億円]

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						12月9日	1
1年超3年以下	3,000～5,500 程度	4,200	2	6	13	18			12月6日	2
3年超5年以下	2,000～4,500 程度	3,400								
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	2	9	25				12月9日	1
25年超	0～500 程度	300								
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	-						12月9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(登金)第 243号　加入協会 日本証券業協会