

DAILY SIGNAL 上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

2019年12月13日(金)

短期市場の推移

	12月9日	12月10日	12月11日	12月12日
加重平均金利	▲0.008	▲0.008	▲0.008	▲0.009
東京レポレート(ON)	▲0.024	▲0.018	▲0.008	▲0.003
無コール残	71,372	76,810	72,595	69,399
ON	49,102	54,560	49,785	46,489
その他	22,270	22,250	22,810	22,910
有コール残	19,870	19,306	18,956	18,851

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16日の予定(時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
8:50	短観(12月業種別計数、「企業の物価見通し」の概要)	22:30	(米)12月ニューヨーク連銀製造業景気指数
17:00	業態別の日銀当座預金残高(11月)	23:45	(米)12月製造業PMI
		23:45	(米)12月サービス業PMI

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	▲0.040	0.001	▲0.008	▲0.020
T/N	-	-	-	▲0.099
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.025	▲0.020	▲0.022	▲0.097
2W	-	-	▲0.023	▲0.099
3W	-	-	-	▲0.110
1M	-	-	-	▲0.109
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.113
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

積み最終日となる本日の無担保コールON物は▲0.005%の出合いから始まった。その後は、主に▲0.010%~▲0.005%の水準で取引された。同加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.001%の▲0.008%となった。

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

翌営業日のマーケット

新積み期に入り、ビッドサイドは慎重な調達姿勢になると予想する。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	12月13日	12月16日	12月16日	12月17日	12月17日	12月17日
券	▲2,800	▲1,600	▲1,600	▲3,000	▲3,000	
財政	+70,200	+1,600	+1,600	+4,000	+4,000	
過不足	+67,400	+0	+0	+1,000	+1,000	
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		
CP等買入	▲500		▲500			
ETF買入				+100		
国債補完供給	+100	▲100	+100			
貸出増加支援			▲17,600	+20,600		
当座預金増減	+66,900	+14,600	+14,600	+1,000	+1,000	
当座預金残高	3,963,200	3,977,800	3,977,800	3,978,800	3,978,800	
準備預金残高	3,442,400	主な需給要因				
積み終了先	3,442,400					
超過準備	3,442,200					
非準預先残高	520,800	国庫短期証券発行・償還(3M)				
準備預金進捗率	100.0%	国債償還(2年)				
平均	100.0%					
乖離率	0.0%					

12月13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(12/16~)						
1~3年	4,200	7,413	4,207	0.006	0.010	36.4
3~5年	3,400	7,443	3,404	0.005	0.008	3.5
5~10年	3,500	6,669	3,509	0.008	0.011	88.0
物価連動	300	1,372	302	▲0.110	▲0.139	82.8
CP等買入(12/18~)	2,500	8,405	2,473	▲0.001	0.000	28.4
国債補完供給(12/13~12/16)						
	101	101	▲0.250	▲0.250		

マナタリーベース [億円]
12月12日時点 5,036,300

所要 [億円]
来積期の所要準備額 3,227,400
12月16日以降の残り所要積数 3,227,400
平均 104.100

国庫短期証券入札予定

12月18日	1年	第877回
12月20日	3ヶ月	第878回
1月7日	3ヶ月	
1月9日	6ヶ月	
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

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			
3年超5年以下	2,000~4,500 程度	3,400	2 6 13 18	12月13日	1
5年超10年以下	2,000~5,000 程度	3,500	6 13 18 25	12月13日	2
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9日	1
物価連動債	300 程度	300	月2回程度	12月13日	0
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12月積み期 [12月14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。