

DAILY SIGNAL

上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

2019年12月16日(月)

短期市場の推移

[億円] [%]

	12月10日	12月11日	12月12日	12月13日
加重平均金利	▲0.008	▲0.008	▲0.009	▲0.008
東京レポレート(ON)	▲0.018	▲0.008	▲0.003	▲0.020
無コール残	76,810	72,595	69,399	60,202
ON	54,560	49,785	46,489	39,142
その他	22,250	22,810	22,910	21,060
有コール残	19,306	18,956	18,851	19,219

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。

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	▲0.087	0.001	▲0.053	▲0.089
T/N	-	-	-	▲0.093
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.030	▲0.025	▲0.029	▲0.096
2W	▲0.035	▲0.029	▲0.031	▲0.110
3W	▲0.025	0.010	▲0.014	▲0.111
1M	-	-	▲0.050	▲0.110
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.114
6M	-	-	-	▲0.159
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

12月17日の予定(時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	22:30 (米)11月住宅着工件数	134.0万戸
-	-	23:15 (米)11月鉱工業生産指数 [前月比]	0.8%
-	-	-	-

経済指標及び予想値は株式会社フィスコ提供

本日の市況

本日の無担保コールON物は、▲0.050%の出会いから始まった。その後は主に▲0.080%～▲0.040%の水準で取引された。新積み期に入り、ビッドサイドが慎重な調達姿勢となったことから、同加重平均金利は前営業日対比▲0.045%の▲0.053%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.080 ~ ▲0.080	▲0.070 ~ ▲0.070	▲0.080 ~ ▲0.030

翌営業日のマーケット

ビッドサイドの調達姿勢に大きな変化はなく、出会いの水準は横ばいを予想。

資金需給

[億円]

	日銀速報	日銀予想	当社需給予想
	12月16日	12月17日	12月18日
券	▲1,700	▲2,300	▲3,000
財政	+1,500	+1,300	▲6,000
過不足	▲200	▲1,000	▲9,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国債買入	+11,900	-	-
CP等買入	▲500	▲200	+2,500
ETF買入	+100	-	-
国債補完供給	+100	+100	-
貸出増加支援	▲17,600	+20,600	-
当座預金増減	+14,300	▲1,100	▲6,500
当座預金残高	3,977,500	3,976,400	3,969,900
準備預金残高	3,462,900	主な需給要因	
積み終了先	2,147,900	国債発行(20年)	
超過準備	870,200		
非準備先残高	514,600		
準備預金進捗率	80.3%		
平均	3.2%		
乖離率	77.1%		

12月16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
国債補完供給(12/16~12/17)						
	1	1	▲0.350	▲0.350		
	48	48	▲0.350	▲0.350		

マネタリーベース [億円]
12月13日時点 5,106,000

所要 [億円]
今積期の所要準備額 3,227,400
12月17日以降の残り所要
積数 634,700
平均 21,200

国庫短期証券入札予定

8月2日	3ヶ月
8月8日	6ヶ月
8月9日	3ヶ月
8月16日	3ヶ月
国債入札予定	
8月1日	10年
8月6日	30年
8月8日	物価運動
8月15日	5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
物価運動債	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。

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