

DAILY SIGNAL 上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

2019年12月18日(水)

短期市場の推移

	12月12日	12月13日	12月16日	12月17日
加重平均金利	▲0.009	▲0.008	▲0.053	▲0.057
東京レポレート(ON)	▲0.003	▲0.020	▲0.089	▲0.090
無コール残	69,399	60,202	82,865	82,098
ON	46,489	39,142	57,790	56,073
その他	22,910	21,060	25,075	26,025
有コール残	18,851	19,219	22,217	21,904

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19日の予定(時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
-	日銀金融政策 決定会合(2日目)	-	22:30	(米)7-9月期経常収支 -1210億米ドル
15:30	黒田日銀総裁、 記者会見	-	22:30	(米)新規失業保険 申請件数[前週分] -
-	-	-	-	(米)フィデリティ 連銀景況感(12月) -

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	▲0.087	0.003	▲0.060	▲0.092
T/N	-	-	-	▲0.096
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.035	0.230	▲0.020	▲0.097
2W	-	-	-	▲0.110
3W	-	-	-	▲0.110
1M	-	-	-	▲0.107
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.115
6M	-	-	-	▲0.159
1Y	-	-	-	▲0.180

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▲0.060%の出合から始まり、その後は▲0.087%~▲0.045%を中心に取引された。昨日に引き続き軟調な地合となり、同加重平均金利(速報)は前日対比▲0.003%の▲0.060%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.087 ~ ▲0.087	- ~ -	▲0.087 ~ ▲0.045

翌営業日のマーケット

本日同様、軟調な地合を予想する。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	12月18日	12月19日	12月19日	12月20日	12月20日	12月21日
券	▲2,500	▲3,900	▲3,900	▲4,000	▲4,000	▲4,000
財政	▲13,500	+2,600	+2,600	+82,000	+82,000	+82,000
過不足	▲16,000	▲1,300	▲1,300	+78,000	+78,000	+78,000
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
国庫短期証券買入		+1,000				
国債買入				+11,300		
CP等買入	▲100	+2,500	▲200			
被災地金融機関支援						▲100
国債補完供給	+200	▲100	+100			
当座預金増減	▲12,500	+9,900	+9,900	+77,900	+77,900	+77,900
当座預金残高	3,962,000	3,971,900	3,971,900	4,049,800	4,049,800	4,049,800
準備預金残高	3,448,900					
積み終了先	3,419,900					
超過準備	3,387,100					
非準預先残高	513,100					
準備預金進捗率	98.6%					
平均	9.7%					
乖離率	89.0%					

12月18日のオペ結果

12月18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	接分
国債買入(12/19~)						
1~3年	4,200	6,798	4,206	▲0.003	▲0.001	52.8
3~5年	3,400	8,367	3,407	▲0.003	▲0.003	53.8
5~10年	3,500	7,801	3,504	▲0.004	▲0.003	97.3
社債等買入(12/24~)						
	750	2,852	750	0.050	0.058	83.4
国債補完供給(12/18~12/19)						
	119	119	▲0.350	▲0.350		

国庫短期証券入札予定

12月20日	3ヶ月	第8/8回
1月7日	3ヶ月	
1月9日	6ヶ月	
1月10日	3ヶ月	
12月24日	2年	
1月7日	10年	
1月9日	30年	
1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18日	0
5年超10年以下	2,000~5,000 程度	3,500	6 13 18 25	12月18日	1
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	-

マナタリーベース [億円]
12月17日時点 5,121,300

所要 [億円]
今積期の所要準備額 3,227,400
12月19日以降の残り所要
積数 44,100
平均 1,600

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。