

DAILY SIGNAL 上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

2019年12月25日(水)

短期市場の推移 [億円] [%]

	12月19日	12月20日	12月23日	12月24日
加重平均金利	▲0.061	▲0.061	▲0.059	▲0.058
東京レポレート(ON)	▲0.091	▲0.080	▲0.064	▲0.068
無コール残	84,758	87,556	83,620	80,302
ON	56,818	58,071	52,365	48,137
その他	27,940	29,485	31,255	32,165
有コール残	23,826	27,475	22,921	23,494

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26日の予定(時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	(米)MBA住宅ローン申請指数[前週比]	-
-	-	(米)新規失業保険申請件数[前週分]	-

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	0.001	▲0.056	▲0.048
T/N	-	-	-	▲0.057
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	-	▲0.076
2W	-	-	-	▲0.074
3W	-	-	-	▲0.073
1M	-	-	-	▲0.080
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.095
6M	-	-	-	▲0.149
1Y	-	-	-	▲0.170

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▲0.050%の出合から始まった。その後は主に▲0.087%~▲0.040%のレンジで取引された。同加重平均金利(速報)は前日対比+0.002%の▲0.056%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.087 ~ ▲0.087	▲0.080 ~ ▲0.080	▲0.087 ~ ▲0.040

翌営業日のマーケット

調達サイドの動向に大きな変化はなく、出合の水準は横ばいと予想する。

資金需給 [億円]

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	12月25日	12月26日	12月26日	12月27日	12月27日	12月28日
券	▲3,600	▲4,900	▲4,900	▲3,000	▲3,000	▲3,000
財政	▲2,800	+800	+800	▲3,000	▲3,000	▲3,000
過不足	▲6,400	▲4,100	▲4,100	▲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
国庫短期証券買入		+5,000				
国債買入			+5,700			
共通担保(全店)					▲5,800	
CP等買入	▲200		▲400			
社債等買入	▲200					
国債補完供給	+100					
当座預金増減	▲1,700	+1,200	+1,200	▲11,800	▲11,800	▲11,800
当座預金残高	4,021,800	4,023,000	4,023,000	4,011,200	4,011,200	4,011,200
準備預金残高	3,515,600	3,515,000	3,515,000	3,515,000	3,515,000	3,515,000
積み終了先	3,515,000					
超過準備	3,514,900					
非準預先残高	506,200					
準備預金進捗率	99.6%					
平均	32.3%					
乖離率	67.4%					

12月25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(12/26~)						
~1年	500	1,188	501	0.006	0.013	91.6
5~10年	3,500	7,672	3,503	▲0.027	▲0.023	96.5
10~25年	1,000	3,174	1,005	▲0.027	▲0.025	54.4
25年~	300	1,192	301	▲0.031	▲0.030	54.7
CP等買入(12/30~)	2,500	7,470	2,490	▲0.001	0.001	35.7

マナタリーベース [億円]	所要 [億円]
12月24日時点 5,186,600	今積期の所要準備額 3,227,400
	12月26日以降の残り所要積数 11,800
	平均 600

国庫短期証券入札予定

1月7日	3ヶ月
1月9日	6ヶ月
1月10日	3ヶ月
1月16日	1年
1月7日	10年
1月9日	30年
1月15日	5年
1月17日	20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25日	0
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25日	0
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25日	0
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。