

# DAILY SIGNAL

上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

2019年12月26日(木)

## 短期市場の推移

[億円] [%]

	12月20日	12月23日	12月24日	12月25日
加重平均金利	▲0.061	▲0.059	▲0.058	▲0.056
東京レポレート(ON)	▲0.080	▲0.064	▲0.068	▲0.048
無コール残	87,556	83,620	80,302	81,346
ON	58,071	52,365	48,137	49,181
その他	29,485	31,255	32,165	32,165
有コール残	27,475	22,921	23,494	24,096

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27日の予定(時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
8:30	11月有効求人倍率	1.57倍	特になし	
8:30	11月失業率	+2.4%	-	
8:50	金融政策決定会合における主な意見(12月18・19日分)	-	-	

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	▲0.055	▲0.055
T/N	-	-	-	▲0.058
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	-	▲0.073
2W	-	-	▲0.005	▲0.070
3W	-	-	-	▲0.070
1M	-	-	-	▲0.076
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.094
6M	-	-	-	▲0.145
1Y	-	-	-	▲0.166

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▲0.045%の出会いから始まった。その後は主に▲0.087%~▲0.040%の水準で取引された。同加重平均金利(速報)は前日対比+0.001%の▲0.055%となった。

都銀・信託		証券	地銀
▲0.087 ~ ▲0.080		▲0.070 ~ ▲0.070	▲0.087 ~ ▲0.035

## 翌営業日のマーケット

週末3日積みとなるため調達意欲が強まり、出会いの水準は小幅上昇と予想。

## 資金需給

[億円]

	日銀速報 12月26日	日銀予想 12月27日	当社需給予想 12月30日
券	▲5,100	▲4,100	▲600
財政	+200	▲2,500	▲800
過不足	▲4,900	▲6,600	▲1,400
金融調節	エンド	スタート	エンド
国債買入	+5,700		
共通担保(全店)		▲5,800	+6,000
CP等買入	▲400	▲1,300	+2,500
当座預金増減	+400	▲7,700	+1,100
当座預金残高	4,022,200	4,014,500	4,015,600
準備預金残高	3,509,400	主な需給要因	
積み終了先	3,509,000		
超過準備	3,509,000		
非率預先残高	512,800		
準備預金進捗率	99.6%		
平均	35.5%		
乖離率	64.2%		

12月26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
共通担保(全店)(12/27~1/14)	15,000	5,997	5,997			

マナタリーベース [億円]  
12月25日時点 5,188,500

所要	[億円]
今積期の所要準備額	3,227,400
12月27日以降の残り所要積数	11,400
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

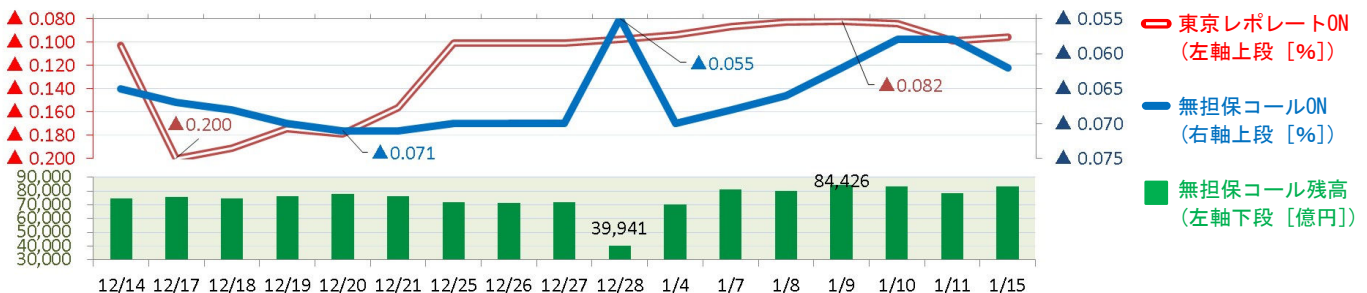
## 今月の国債買入オペ予定

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。