

# DAILY SIGNAL 上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

2019年12月27日(金)

## 短期市場の推移

	12月23日	12月24日	12月25日	12月26日
加重平均金利	▲0.059	▲0.058	▲0.056	▲0.055
東京レポレート(ON)	▲0.064	▲0.068	▲0.048	▲0.055
無コール残	83,620	80,302	81,346	81,072
ON	52,365	48,137	49,181	48,657
その他	31,255	32,165	32,165	32,415
有コール残	22,921	23,494	24,096	20,862

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30日の予定(時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
19:30頃 日銀当座預金増減要因と 金融調節(12月実績速報)	-	(米)11月の財の貿易収支	
		(米)11月の中古 住宅販売仮契約	
		(米)12月のダラス連銀 製造業活動指数	

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	▲0.086	0.001	▲0.051	▲0.056
T/N	-	-	-	▲0.060
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	-	▲0.062
2W	-	-	▲0.035	▲0.063
3W	-	-	-	▲0.067
1M	-	-	▲0.010	▲0.074
2M	-	-	▲0.020	-
3M	-	-	-	▲0.093
6M	-	-	-	▲0.145
1Y	-	-	-	▲0.164

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

週末3日積みとなる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▲0.085%~▲0.030%の水準で取引された。同加重平均金利(速報)は5営業日連続で上昇し、前日対比+0.004%の▲0.051%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.080 ~ ▲0.080	▲0.070 ~ ▲0.070	▲0.085 ~ ▲0.030

## 翌営業日のマーケット

年末初物となるため、一部のビッドサイドは調達を控える動きが予想される。

## 資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想
	12月27日	12月30日	12月30日	12月30日	1月6日
券	▲4,200	▲1,400	▲1,400	▲1,400	+6,000
財政	▲2,500	▲5,900	▲5,900	▲5,900	▲21,000
過不足	▲6,700	▲7,300	▲7,300	▲7,300	▲15,000
金融調節	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド
共通担保(全店)	▲5,800	+6,000	▲800	+2,500	
CP等買入	▲1,300				
当座預金増減	▲7,800	▲5,600	▲5,600	▲5,600	▲15,000
当座預金残高	4,014,400	4,008,800	4,008,800	4,008,800	3,993,800
準備預金残高	3,501,900	3,501,900	3,501,900	3,501,900	3,501,900
積み終了先	3,501,000	3,501,000	3,501,000	3,501,000	3,501,000
超過準備	3,501,000	3,501,000	3,501,000	3,501,000	3,501,000
非準備先残高	512,500	512,500	512,500	512,500	512,500
準備預金進捗率	99.7%	99.7%	99.7%	99.7%	99.7%
平均	45.2%	45.2%	45.2%	45.2%	45.2%
乖離率	54.6%	54.6%	54.6%	54.6%	54.6%

12月27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

マナタリーベース [億円]	所要 [億円]
12月26日時点 5,194,000	今積期の所要準備額 3,227,300
	12月30日以降の残り所要積数 8,600
	平均 500

## 国庫短期証券入札予定

1月7日	3ヶ月	第879回
1月9日	6ヶ月	第880回
1月10日	3ヶ月	第881回
1月16日	1年	第882回
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	0

## 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。