

DAILY SIGNAL

上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

平成30年12月12日(水)

短期市場の推移

[億円][%]

	12月6日	12月7日	12月10日	12月11日
加重平均金利	▲0.070	▲0.067	▲0.068	▲0.068
東京レポレート(ON)	▲0.089	▲0.088	▲0.085	▲0.085
無コール残	82,221	78,525	84,804	91,167
ON	52,096	47,090	52,689	58,952
その他	30,125	31,435	32,115	32,215
有コール残	33,178	25,937	29,863	30,387

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13日の予定(時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
		22:30	(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	▲0.086	0.001	▲0.066	▲0.084
T/N	-	-	▲0.015	▲0.084
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	0.000	▲0.144
2W	▲0.035	▲0.020	▲0.028	▲0.161
3W	-	-	-	▲0.290
1M	-	-	-	▲0.273
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.173
6M	-	-	-	▲0.162
1Y	-	-	-	▲0.163

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▲0.085%の出合から始まった。その後は▲0.086%~▲0.035%の水準で取引された。昨日よりも積極的に調達をする先が増えたことで、同加重平均金利は前営業日対比+0.002%の▲0.066%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.085 ~ ▲0.080	-	▲0.086 ~ ▲0.035

翌営業日のマーケット

積最終日を前に本日よりも若干地合いは上昇すると予想。

資金需給

[億円]

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	12月12日	12月13日	12月12日	12月13日	12月14日	12月15日
券	▲2,000	▲3,100	▲2,000	▲3,100	▲3,000	▲3,000
財政	▲7,800	+4,800	▲7,800	+4,800	+56,000	+56,000
過不足	▲9,800	+1,700	▲9,800	+1,700	+53,000	+53,000
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				
CP等買入	▲500		▲400			
社債等買入	▲100					+2,000
ETF買入				+700		
国債補完供給	+3,600	▲600	+600			
貸出増加支援					▲31,300	
当座預金増減	▲6,400	+2,600	▲6,400	+2,600	+23,700	+23,700
当座預金残高	3,771,700	3,774,300	3,771,700	3,774,300	3,798,000	3,798,000
準備預金残高	3,359,900		3,359,900			
積み終了先	3,359,700		3,359,700			
超過準備	3,359,700		3,359,700			
非準備先残高	411,800		411,800			
準備預金進捗率	99.9%		99.9%			
平均	90.0%		90.0%			
乖離率	9.9%		9.9%			

12月12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
国債補完供給(12/12~12/13)						
	77,358	571	571	▲0.600	▲0.600	
	5,053	33	33	▲0.600	▲0.600	

マネタリーベース [億円]
12月11日時点 4,891,400

所要 [億円]
今積期の所要準備額 3,011,600
12月13日以降の残り所要積数 600
平均 200

国庫短期証券入札予定

12月14日	3ヶ月	第802回
12月19日	1年	第803回
12月21日	3ヶ月	
1月8日	3ヶ月	

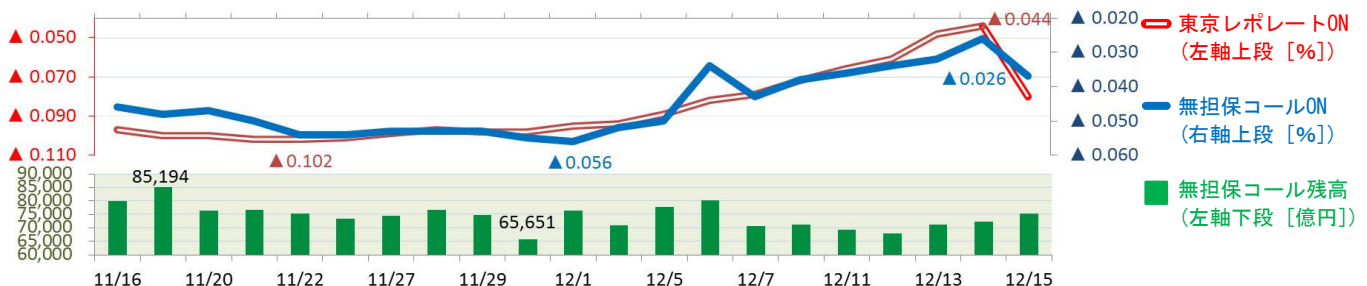
今月の国債買入オペ予定

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3日	1
1年超3年以下	2,500~4,500 程度	3,500			
3年超5年以下	3,000~5,500 程度	4,000	3 10 17 25	12月10日	2
5年超10年以下	3,000~6,000 程度	4,500	5 10 14 19 27	12月10日	3
10年超25年以下	1,500~2,500 程度	2,000			
25年超	100~1,000 程度	500	5 14 25 27	12月5日	3
物価連動債	250 程度	250	月2回程度	12月5日	1
変動利付債<偶数月>	1,000 程度	1,000	1回	10月17日	1

1年前の市場推移

○2017年11月積み期 [11月16日~12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(登録)第243号 加入協会 日本証券業協会