

DAILY SIGNAL 上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

平成30年12月17日(月)

短期市場の推移

	12月11日	12月12日	12月13日	12月14日
加重平均金利	▲0.068	▲0.066	▲0.062	▲0.065
東京レポレート(ON)	▲0.085	▲0.084	▲0.083	▲0.103
無コール残	91,167	90,291	85,894	74,800
ON	58,952	58,476	54,209	45,535
その他	32,215	31,815	31,685	29,265
有コール残	30,387	30,429	29,975	23,006

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18日の予定(時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	22:30 (米)11月住宅着工件数	123.3万戸
-	-	(米)FOMC(19日まで)	-
-	-	-	-

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	▲0.067	▲0.200
T/N	-	-	▲0.015	▲0.226
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.053	0.230	▲0.045	▲0.227
2W	-	-	-	▲0.365
3W	-	-	-	▲0.339
1M	-	-	-	▲0.316
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.178
6M	-	-	-	▲0.164
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

本日の無担保コールON物は▲0.086%の出合から始まった。その後は主に▲0.086%~▲0.045%の水準で取引された。新積み期に入ったものの、先週末同様ビッドサイドが慎重な姿勢となり、同加重平均金利は前営業日対比▲0.002%の▲0.067%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.086 ~ ▲0.086	▲0.086 ~ ▲0.086	▲0.086 ~ ▲0.045

翌営業日のマーケット

引き続きビッドサイドは慎重な調達姿勢になると予想する。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	12月17日	12月18日	12月17日	12月18日	12月19日	12月20日
券	▲1,700	▲2,700	▲1,700	▲2,700	▲4,000	▲4,000
財政	+10,400	+2,400	+10,400	+2,400	+12,000	+12,000
過不足	+8,700	▲300	+8,700	▲300	+16,000	+16,000
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
国債買入	+7,000	+8,600	+7,000	+8,600	-	-
共通担保(全店)	▲1,900	+1,900	▲1,900	+1,900	-	-
CP等買入	▲400	-	▲200	-	-	-
社債等買入	-	-	▲300	-	-	-
ETF買入	+1,700	-	+1,700	-	-	-
国債補完供給	+700	▲1,200	+700	▲1,200	-	-
当座預金増減	+16,500	+9,000	+16,500	+9,000	+16,000	+16,000
当座預金残高	3,833,100	3,842,100	3,833,100	3,842,100	3,826,100	3,826,100
準備預金残高	3,333,500	3,333,500	3,333,500	3,333,500	3,333,500	3,333,500
積み終了先	3,237,100	3,237,100	3,237,100	3,237,100	3,237,100	3,237,100
超過準備	2,825,500	2,825,500	2,825,500	2,825,500	2,825,500	2,825,500
非準預先残高	499,600	499,600	499,600	499,600	499,600	499,600
準備預金進捗率	96.1%	96.1%	96.1%	96.1%	96.1%	96.1%
平均	6.5%	6.5%	6.5%	6.5%	6.5%	6.5%
乖離率	89.6%	89.6%	89.6%	89.6%	89.6%	89.6%

12月17日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	接分
国債買入(12/18~)						
1~3年	3,500	7,905	3,502	▲0.001	0.001	47.1
3~5年	4,000	11,032	4,004	▲0.007	▲0.006	91.1
変動利付	1,000	2,168	1,000	▲0.140	▲0.189	21.0
国債補完供給(12/17~12/18)						
	141,117	1,136	1,136	▲0.600	▲0.600	

マナタリーベース	所要
12月14日時点 4,937,800	今積み期の所要準備額 3,124,000
	12月18日以降の残り所要積数 122,400
	平均 4.200

国庫短期証券入札予定

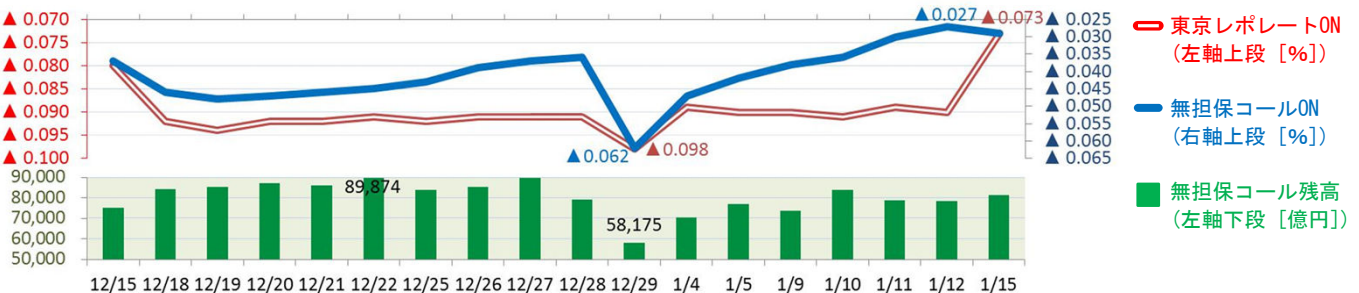
12月19日	1年	第803回
12月21日	3ヶ月	第804回
1月8日	3ヶ月	
1月9日	6ヶ月	
12月18日	20年	
12月26日	2年	
1月8日	10年	
1月10日	30年	

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17日	1
5年超10年以下	3,000~6,000 程度	4,300	5 10 14 19 27	12月14日	2
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14日	2
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	12月17日	0

1年前の市場推移 ○2017年12月積み期 [12月15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。