

# DAILY SIGNAL 上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

平成30年12月20日(木)

## 短期市場の推移

	12月14日	12月17日	12月18日	12月19日
加重平均金利	▲0.065	▲0.067	▲0.068	▲0.070
東京レポレート(ON)	▲0.103	▲0.200	▲0.191	▲0.174
無コール残	74,800	75,564	74,655	76,253
ON	45,535	44,649	41,360	42,418
その他	29,265	30,915	33,295	33,835
有コール残	23,006	12,352	11,224	11,451

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21日の予定(時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
8:30	11月消費者物価コア指数 [前年比]	+1.0%	22:30	(米)7-9月期国内総生産 (GDP)確報値 [前期比年率]	3.5%
8:50	資金循環統計(速報) (7~9月期)	-	22:30	(米)11月耐久財受注 [前月比]	2.0%
-	【記者会見】黒田総裁 (12月20日)	-	-	(欧)ユーロ圏12月 消費者信頼感	-

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	▲0.071	▲0.179
T/N	-	-	▲0.015	▲0.200
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.070	▲0.015	▲0.049	▲0.205
2W	-	-	▲0.030	▲0.308
3W	-	-	-	▲0.273
1M	-	-	0.015	▲0.249
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.179
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。同加重平均金利は前営業日対比▲0.001%の▲0.071%と、5営業日連続で低下した。

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

ビッドサイドの調達姿勢は変わらず、軟調な地合が継続すると予想する。

## 資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	12月20日	12月21日	12月21日	12月25日	12月25日	12月25日
券	▲4,200	▲4,600	▲4,600	▲2,000	▲2,000	
財政	+71,900	+4,900	+4,900	▲4,000	▲4,000	
過不足	+67,700	+300	+300	▲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
国債買入		+5,200				
共通担保(全店)					▲3,100	
CP等買入	▲200		▲800			
社債等買入	▲400				+800	
被災地金融機関支援			▲100	+100		
国債補完供給	+200	▲100	+100			
当座預金増減	+72,400	▲400	▲400	▲8,300	▲8,300	
当座預金残高	3,898,700	3,898,300	3,898,300	3,890,000	3,890,000	
準備預金残高	3,376,400					
積み終了先	3,364,900					
超過準備	3,358,900					
非準備預金残高	522,300					
準備預金進捗率	99.2%					
平均	16.1%					
乖離率	83.1%					

## 12月20日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	接分
国債補完供給(12/20~12/21)						
	80,017	141	141	▲0.600	▲0.600	
	2,614	3	3	▲0.600	▲0.600	

マナタリーベース [億円]  
12月19日時点 4,955,000

所要	所要準備額
今積期の所要準備額	3,120,800
12月21日以降の残り所要積数	24,200
平均	900

## 国庫短期証券入札予定

12月21日	3ヶ月	第804回
1月8日	3ヶ月	
1月9日	6ヶ月	
1月11日	3ヶ月	
12月26日	2年	
1月8日	10年	
1月10日	30年	
1月16日	5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19日	0
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19日	1
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19日	0
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。