

DAILY SIGNAL 上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

2020年12月1日(火)

短期市場の推移

	11月25日	11月26日	11月27日	11月30日
加重平均金利	▲0.030	▲0.030	▲0.030	▲0.032
東京レポレート(ON)	▲0.079	▲0.078	▲0.079	▲0.077
無コール残	102,138	106,857	120,085	100,290
ON	61,220	65,459	79,647	60,852
その他	40,918	41,398	40,438	39,438
有コール残	22,276	21,699	20,784	19,423

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2日の予定 (時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
8:50	マナターベース(11月)	-	0:00 (米)11月ISM製造業景況指数	57.6
8:50	国内銀行の資産・負債等(銀行勘定)(10月末)	-	22:15 (米)11月ADP全米雇用報告	50.0万人
10:30	【挨拶】両宮副総裁(秋田)	-	(米)地区連銀経済報告(ページブック)	-

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	▲0.075	0.001	▲0.030	▲0.076
T/N	▲0.020	▲0.001	▲0.007	▲0.080
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.030	0.000	▲0.017	▲0.083
2W	▲0.020	0.000	▲0.017	▲0.084
3W	-	-	-	▲0.090
1M	-	-	-	▲0.102
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.108
6M	-	-	-	▲0.131
1Y	-	-	-	▲0.155

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▲0.040%の割合から始まり、その後は主に▲0.045%~▲0.020%の水準で出合が見られた。月末に調達を控えていた先が戻ったこともあり、金利水準は若干の強含みで、同加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.002%の▲0.030%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.050 ~ ▲0.040	- ~ -	▲0.050 ~ ▲0.015

翌営業日のマーケット

税揚げ等の影響から調達ニーズがやや強くなり、出合水準は小幅上昇を想定する。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	12月1日	12月2日	12月1日	12月2日	12月3日	12月4日
券	▲500	▲1,100	▲500	▲1,100	▲2,000	▲2,000
財政	▲34,500	▲97,300	▲34,500	▲97,300	+2,000	+2,000
過不足	▲35,000	▲98,400	▲35,000	▲98,400	+0	+0
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				+30,000		
国債買入		+6,100				
共通担保(全店)			▲1,400	+1,900		
CP等買入	▲400		▲200			
国債補完供給	+100	▲300	+300			
成長基盤強化支援			▲6,700	+1,700		
当座預金増減	▲29,500	▲72,800	▲29,500	▲72,800	+0	+0
当座預金残高	4,838,500	4,765,700	4,838,500	4,765,700	4,765,700	4,765,700
準備預金残高	4,264,800		4,264,800			
積み終了先	4,264,700		4,264,700			
超過準備	4,264,500		4,264,500			
非準備預金残高	573,700		573,700			
準備預金進捗率	99.9%		99.9%			
平均	53.3%		53.3%			
乖離率	46.6%		46.6%			

12月1日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	接分
国庫短期証券買入(12/2~)	30,000	56,847	30,007	0.003	0.005	93.6
米ドル資金供給(12/3~12/10)	0	0	0	0.330	0.330	
米ドル資金供給(12/3~2/26)	0	0	0	0.330	0.330	
国債補完供給(12/1~12/2)	283	283	▲0.350	▲0.350		
共通担保(全店)(12/2~12/16)	20,000	1,851	1,851			

マナターベース(億円)	所要(億円)
11月30日時点 6,059,200	今積期の所要準備額 3,451,500
	12月2日以降の残り所要積数 200
	平均 0

国庫短期証券入札予定

12月4日	3ヶ月	第956回
12月9日	6ヶ月	
12月11日	3ヶ月	
12月15日	6ヶ月	
12月3日	30年	
12月8日	5年	
12月10日	20年	
12月24日	2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	1,000~2,000	1,000	月2回程度	10月30日	2
1年超3年以下	3,500~6,500	4,200	5 11 17 24 26	10月30日	5
3年超5年以下	2,500~6,000	3,500	5 11 17 24 30	10月30日	5
5年超10年以下	2,500~6,000	4,200	9 11 17 24 26	10月30日	5
10年超25年以下	500~2,000	1,200	9 26	10月26日	2
25年超	0~500	300	5 30	10月26日	2
物価連動債	300	300	月2回程度	10月21日	2
変動利付債<偶数月>	500	500	月1回	10月7日	-

1年前の市場推移

○2019年10月積み期 [10月16日~11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。