

短期市場の推移

	12月1日	12月2日	12月3日	12月4日
加重平均金利	▲0.030	▲0.029	▲0.030	▲0.030
東京レポレート(ON)	▲0.076	▲0.077	▲0.076	▲0.077
無コール残	99,557	102,258	111,523	126,756
ON	60,849	63,935	70,650	85,863
その他	38,708	38,323	40,873	40,893
有コール残	20,494	21,321	20,513	20,503

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8日の予定(時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
8:50	7-9月期国内総生産(GDP)改定値[前期比年率]	+21.6%	(米)非農業部門労働生産性(3Q)	
8:50	10月国際収支(経常収支)	21171億円	19:00 (欧)7-9月期域内総生産(GDP)改定値[前年比]	-4.3%

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	▲0.028	▲0.077
T/N	▲0.050	▲0.001	▲0.008	▲0.080
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	0.000	▲0.081
2W	-	-	-	▲0.084
3W	-	-	▲0.020	▲0.089
1M	-	-	-	▲0.100
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.106
6M	-	-	-	▲0.130
1Y	-	-	-	▲0.154

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▲0.020%の出合から始まり、その後は地銀の調達意欲が強く、▲0.045%~▲0.015%の水準で出合が見られた。同加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.002%の▲0.028%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.045 ~ ▲0.040	▲0.028 ~ ▲0.028	▲0.045 ~ ▲0.015

翌営業日のマーケット

出合いの水準は本日対比横ばいを想定。

資金需給

	日銀速報 12月7日	日銀予想 12月8日	当社需給予想 12月9日
券	▲600	▲1,200	▲2,000
財政	▲3,000	+13,800	▲26,000
過不足	▲3,600	+12,600	▲28,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国債買入	+5,600	+5,900	
CP等買入	▲100	▲300	
社債等買入	▲400		
ETF買入		+100	
国債補完供給	+300	+300	
当座預金増減	+7,500	+18,600	▲28,000
当座預金残高	4,781,400	4,800,000	4,772,000
準備預金残高	4,191,400	主な需給要因	
積み終了先	4,191,400		
超過準備	4,191,400		
非準預先残高	590,000	国債発行(5年)	
準備預金進捗率	99.9%		
平均	73.3%		
乖離率	26.6%		

12月7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
国債買入(12/8~)						
1~3年	5,000	13,882	5,006	▲0.004	▲0.002	42.7
25年~	300	1,277	304	0.005	0.006	15.8
変動利付	500	682	500	▲0.390	▲0.422	20.0
社債等買入(12/10~)	3,000	4,538	3,000	▲0.033	▲0.018	56.8
国債補完供給(12/7~12/8)						
	159	159	▲0.350	▲0.350		
	87	87	▲0.350	▲0.350		

マナタリーベース [億円]
 12月4日時点 5,970,000

所要 [億円]
 今積期の所要準備額 3,459,500
 12月8日以降の残り所要積数 100
 平均 0

国庫短期証券入札予定

12月9日	6ヶ月	第957回
12月11日	3ヶ月	第958回
12月15日	6ヶ月	
12月16日	1年	
12月8日	5年	
12月10日	20年	
12月24日	2年	
1月6日	10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	1,500	月2回程度	12月2日	1
1年超3年以下	3,500~6,500	5,000	2 7 11 16 21	12月7日	3
3年超5年以下	2,500~6,000	4,200	2 11 16 21 25	12月2日	4
5年超10年以下	2,500~6,000	4,200	4 11 16 21 25	12月4日	4
10年超25年以下	500~2,000	1,200	4 25	12月4日	1
25年超	0~500	300	7 25	12月7日	1
物価連動債	300	300	月2回程度	11月26日	2
変動利付債<偶数月>	500	500	月1回	12月7日	0

1年前の市場推移

○2019年11月積み期 [11月15日~12月13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。