

短期市場の推移

	12月2日	12月3日	12月4日	12月7日
加重平均金利	▲0.029	▲0.030	▲0.030	▲0.028
東京レポレート(ON)	▲0.077	▲0.076	▲0.077	▲0.077
無コール残	102,258	111,523	126,756	101,734
ON	63,935	70,650	85,863	60,491
その他	38,323	40,873	40,893	41,243
有コール残	21,321	20,513	20,503	19,606

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9日の予定(時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
8:50 10月コア機械受注[前月比]	+2.7%	(米)週間 MBA住宅ローン申請指数	
-		(米)10月 JOLT求人数	
-		-	

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	▲0.084
T/N	▲0.050	▲0.001	▲0.009	▲0.091
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.033	0.000	▲0.017	▲0.087
2W	-	-	▲0.015	▲0.088
3W	-	-	0.001	▲0.090
1M	-	-	-	▲0.100
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.106
6M	-	-	-	▲0.129
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、その後は主に▲0.045%～▲0.015%の水準で出合が見られた。同加重平均金利(速報)は前営業日対比横ばいの▲0.028%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.040 ~ ▲0.040	▲0.040 ~ ▲0.030	▲0.040 ~ ▲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圏を想定。

資金需給

	日銀速報	日銀予想	当社需給予想
	12月8日	12月9日	12月10日
券	▲1,200	▲1,000	▲3,000
財政	+16,300	▲22,400	▲29,000
過不足	+15,100	▲23,400	▲32,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国庫短期証券買入			+25,000
国債買入	+5,900	▲600	
CP等買入	▲300	▲100	
社債等買入			+3,000
ETF買入	+100	+600	
国債補完供給	+300	+100	
当座預金増減	+21,000	+1,600	▲29,000
当座預金残高	4,802,400	4,804,000	4,775,000
準備預金残高	4,202,900		
積み終了先	4,202,900		
超過準備	4,202,900		
非準備先残高	599,500		
準備預金進捗率	99.9%		
平均	76.7%		
乖離率	23.2%		

12月8日のオペ結果 [元][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	按分
国庫短期証券買入(12/9~)	25,000	44,417	25,003	▲0.002	0.003	59.5
米ドル資金供給(12/10~12/17)		0	0	0.340	0.340	
米ドル資金供給(12/10~3/4)		0	0	0.330	0.330	
国債補完供給(12/8~12/9)	99	99	▲0.350	▲0.350		
	9	9	▲0.350	▲0.350		

マネタリーベース [億円]
12月7日時点 5,978,200

所要 [億円]
今積期の所要準備額 3,459,500
12月9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 第959回
12月16日 1年
国債入札予定
12月10日 20年
12月24日 2年
1月6日 10年
1月8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	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。