

2020年12月15日(火)

短期市場の推移

[億円] [%]

	12月9日	12月10日	12月11日	12月14日
加重平均金利	▲0.032	▲0.032	▲0.030	▲0.028
東京レポレート(ON)	▲0.084	▲0.082	▲0.081	▲0.070
無コール残	124,594	120,310	121,711	113,169
ON	82,796	77,592	72,193	73,426
その他	41,798	42,718	49,518	39,743
有コール残	20,490	20,755	21,859	21,786

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16日の予定(時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-		22:30 (米)11月小売売上高	-0.2%
-		23:45 (米)12月製造業購買部担当者指数(PMI)	55.8
-		23:45 (米)12月サービス業購買部担当者指数(PMI)	55.0

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	▲0.080	0.001	▲0.023	▲0.071
T/N	▲0.001	0.000	▲0.001	▲0.079
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.030	▲0.018	▲0.023	▲0.083
2W	▲0.035	▲0.015	▲0.026	▲0.084
3W	-	-	-	▲0.098
1M	-	-	0.130	▲0.101
2M	0.010	0.020	0.018	-
3M	-	-	-	▲0.105
6M	-	-	-	▲0.125
1Y	-	-	-	▲0.148

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▲0.035%~▲0.015%の水準で出合が見られた。積み期最終日であり大手行を中心としたビッドサイドの調達意欲が堅調であったため、同加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.005%の▲0.023%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.035 ~ ▲0.025	▲0.035 - ▲0.015	▲0.035 ~ ▲0.015

翌営業日のマーケット

新積み期初日のためビッドサイドは慎重な動きとなり出合いの水準は低下すると予想。

資金需給

[億円]

	日銀速報	日銀予想	当社需給予想
	12月15日	12月16日	12月17日
券	▲1,900	▲2,000	▲3,000
財政	+77,100	▲39,500	+5,000
過不足	+75,200	▲41,500	+2,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国庫短期証券買入	+25,000		
共通担保(全店)		▲1,900	+3,500
CP等買入	▲1,100	▲100	+6,000
社債等買入	▲100		
国債補完供給	+1,300	▲100	+100
貸出増加支援	▲49,000	+54,700	
当座預金増減	+105,900	▲39,900	+8,000
当座預金残高	4,868,200	4,828,300	4,836,300
準備預金残高	4,270,500		
積み終了先	4,270,500		
超過準備	4,270,500		
非準備先残高	597,700		
準備預金進捗率	100.0%		
平均	100.0%		
乖離率	0.0%		

12月15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	按分
米ドル資金供給(12/17~12/24)		0	0	0.340	0.340	
米ドル資金供給(12/17~3/11)		0	0	0.330	0.330	
国債補完供給(12/15~12/16)		103	103	▲0.350	▲0.350	
共通担保(全店)(12/16~12/28)		20,000	3,451	3,451		

マネタリーベース [億円]
12月14日時点 5,966,400

所要 [億円]
来積み期の所要準備額 3,581,400
12月16日以降の残り所要
積数 3,581,400
平均 115,500

国庫短期証券入札予定

12月16日	1年	第960回
12月17日	3ヶ月	第961回
1月5日	3ヶ月	
1月7日	6ヶ月	
国債入札予定		
12月24日	2年	
1月6日	10年	
1月8日	30年	
1月13日	5年	

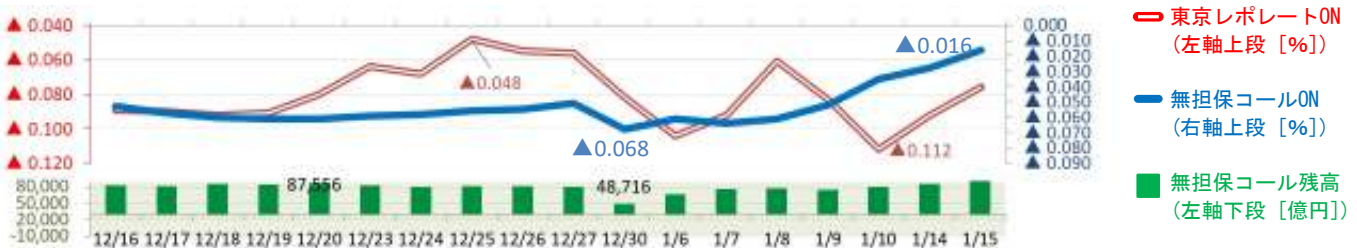
今月の国債買入オペ予定

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	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11日	2
3年超5年以下	2,500~6,000	4,200	2 11 16 21 25	12月11日	3
5年超10年以下	2,500~6,000	4,200	4 11 16 21 25	12月11日	3
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	12月11日	1
変動利付債<偶数月>	500	500	月1回	12月7日	-

1年前の市場推移

○2019年12月積み期 [12月16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。

上田八木短資株式会社 登録金融機関 近畿財務局長(登金)第243号 加入協会 日本証券業協会