

2020年12月17日(木)

短期市場の推移

[億円] [%]

	12月11日	12月14日	12月15日	12月16日
加重平均金利	▲0.030	▲0.028	▲0.023	▲0.033
東京レポレート(ON)	▲0.081	▲0.070	▲0.071	▲0.073
無コール残	121,711	113,169	110,663	107,315
ON	72,193	73,426	72,640	66,847
その他	49,518	39,743	38,023	40,468
有コール残	21,859	21,786	23,133	21,938

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18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]	▲0.9%	22:30 (米)7-9月期経常収支	-188.6億米ドル
12月日銀金融政策 決定会合(2日目)			
黒田総裁記者会見		-	

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	▲0.027	▲0.073
T/N	▲0.010	0.001	▲0.003	▲0.079
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.050	▲0.015	▲0.019	▲0.081
2W	-	-	-	▲0.091
3W	-	-	-	▲0.094
1M	-	-	-	▲0.098
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.103
6M	-	-	-	▲0.124
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%の出合から始まった。
その後は主に▲0.030%~▲0.018%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+0.006%の▲0.027%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.060 ~ ▲0.055	▲0.020 ~ ▲0.020	▲0.050 ~ ▲0.015

翌営業日のマーケット

3日積みということもあり、出合水準は上昇すると予想。

資金需給

[億円]

	日銀速報	日銀予想	当社需給予想
	12月17日	12月18日	12月21日
券	▲2,700	▲2,700	▲3,000
財政	+4,100	+19,400	+78,000
過不足	+1,400	+16,700	+75,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国債買入	+15,100	▲1,300	
CP等買入	▲500	+6,000	▲1,000
社債等買入			▲100
被災地金融機関支援			+100
国債補完供給	+1,000	▲100	
当座預金増減	+22,900	+14,400	+75,000
当座預金残高	4,849,700	4,864,100	4,939,100
準備預金残高	4,269,100		
積み終了先	4,220,100		
超過準備	3,819,700		
非準備先残高	580,600		
準備預金進捗率	98.7%		
平均	6.5%		
乖離率	92.2%		

12月17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
国債補完供給(12/17~12/18)		54	54	▲0.350	▲0.350	
		0	0			

マネタリーベース [億円]
12月16日時点 6,034,900

所要 [億円]
今積期の所要準備額 3,581,400
12月18日以降の残高所要
積数 47,500
平均 1,600

国庫短期証券入札予定

1月5日	3ヶ月
1月7日	6ヶ月
1月8日	3ヶ月
1月15日	3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

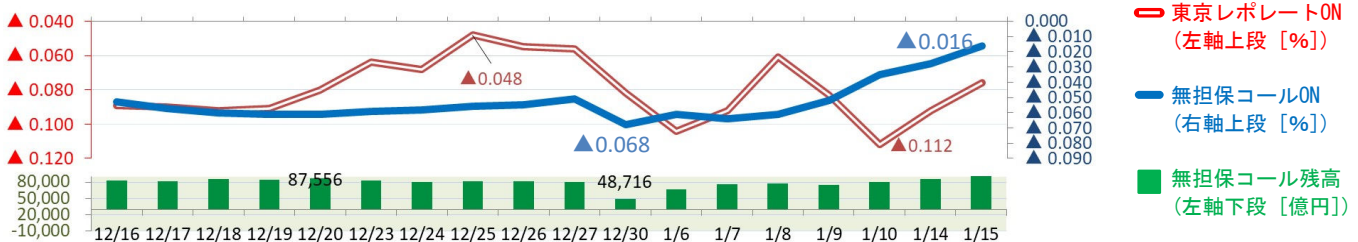
今月の国債買入オペ予定

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16日	0
1年超3年以下	3,500~6,000	5,000	2 7 11 16 21	12月16日	1
3年超5年以下	2,500~6,000	4,200	2 11 16 21 25	12月16日	2
5年超10年以下	2,500~6,000	4,200	4 11 16 21 25	12月16日	2
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	0

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