

短期市場の推移

	12月15日	12月16日	12月17日	12月18日
加重平均金利	▲0.023	▲0.033	▲0.027	▲0.022
東京レポレート(ON)	▲0.071	▲0.073	▲0.073	▲0.072
無コール残	110,663	107,315	111,139	114,760
ON	72,640	66,847	70,646	71,517
その他	38,023	40,468	40,493	43,243
有コール残	23,133	21,938	22,869	22,254

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22日の予定(時刻は日本時間)

時刻	日本	予想	海外	予想	
14:00	基調的なインフレ率を捕捉するための指標	-	16:00	(英)7-9月期国内総生産(GDP)改定値[前年比]	-
-	-	-	22:30	(米)7-9月期国内総生産(GDP)確定値[前期比年率]	33.1%
-	-	-	-	-	-

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	▲0.022	▲0.073
T/N	▲0.001	0.001	▲0.001	▲0.080
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.060	▲0.015	▲0.021	▲0.080
2W	-	-	-	▲0.091
3W	-	-	-	▲0.094
1M	-	-	-	▲0.097
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.102
6M	-	-	-	▲0.123
1Y	-	-	-	▲0.147

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▲0.015%の出合から始まった。引継ぎ地銀の調達意欲が強く、その後は主に▲0.020%~▲0.015%の水準で出合が見られた。同加重平均金利(速報)は前営業日対比横這いの▲0.022%となった。

都銀・信託		証券	地銀
▲0.050 ~ ▲0.040		▲0.030 ~ ▲0.015	▲0.025 ~ ▲0.015

翌営業日のマーケット

調達動向に大きな変化はなく、出合の水準は本日対比横ばいを予想する。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	12月21日	12月22日	12月22日	12月23日	12月23日	12月24日
券	▲1,900	▲2,300	▲2,300	▲4,000	▲4,000	▲4,000
財政	+66,100	▲500	▲500	▲2,000	▲2,000	▲2,000
過不足	+64,200	▲2,800	▲2,800	▲6,000	▲6,000	▲6,000
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				+20,000		
国債買入				+13,800		
CP等買入	▲600		▲300			
社債等買入			▲200			
ETF買入		+100				
国債補完供給	+300	▲100	+100			
当座預金増減	+63,900	+30,600	+30,600	▲6,000	▲6,000	▲6,000
当座預金残高	4,928,000	4,958,600	4,958,600	4,952,600	4,952,600	4,952,600
準備預金残高	4,349,300					
積み終了先	4,347,100					
超過準備	4,347,100					
非準預先残高	578,700					
準備預金進捗率	99.7%					
平均	19.4%					
乖離率	80.4%					

12月21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
国庫短期証券買入(12/22~)	20,000	45,446	20,005	0.000	0.001	93.3
国債買入(12/22~)						
1~3年	5,000	10,466	5,001	▲0.007	▲0.003	8.1
3~5年	4,200	13,517	4,206	0.000	0.001	34.4
5~10年	4,200	12,810	4,204	▲0.003	▲0.001	36.1
物価連動	300	1,667	300	▲0.080	▲0.141	76.0
社債等買入(12/24~)	2,000	3,388	2,000	0.061	0.094	0.4
国債補完供給(12/21~12/22)						
	94	94	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マナタリーベース [億円]
 12月18日時点 6,077,700

所要 [億円]
 今積期の所要準備額 3,581,400
 12月22日以降の残り所要積数 9,900
 平均 400

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
12月24日	2年
1月6日	10年
1月8日	30年
1月13日	5年

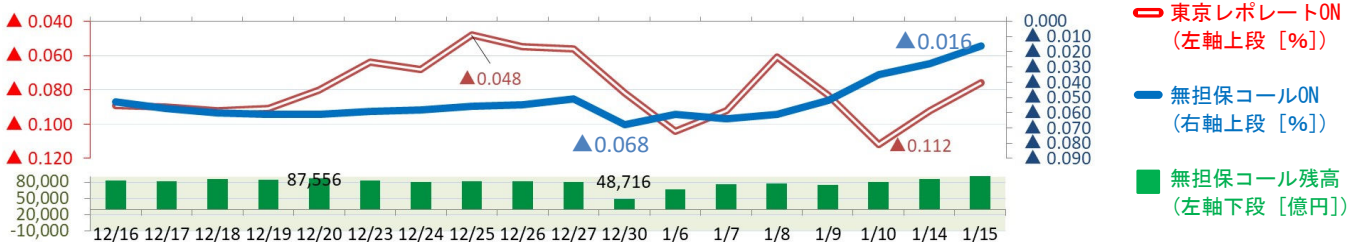
今月の国債買入オペ予定

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