



短期市場の推移

	12月22日	12月23日	12月24日	12月25日
加重平均金利	▲0.020	▲0.019	▲0.021	▲0.016
東京レボレート(TN)	▲0.083	▲0.089	▲0.085	▲0.085
無コール残	103,226	109,090	113,897	118,031
ON	57,258	62,532	67,119	72,503
その他	45,968	46,558	46,778	45,528
有コール残	23,406	23,673	23,118	21,963

加重平均金利・コール残高は日銀、東京レボ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。

本日の短期市場金利

	無担保コール(速報)			レボ市場	
	最低	最高	平均	東京レボレート	
O/N	▲0.070	0.001	▲0.019	▲0.079	
T/N	-	-	▲0.010	▲0.081	
S/N	-	-	-	-	
1W	▲0.014	0.010	▲0.004	▲0.088	
2W	-	-	▲0.010	▲0.089	
3W	-	-	-	▲0.092	
1M	-	-	▲0.001	▲0.094	
2M	-	-	-	-	
3M	-	-	-	▲0.100	
6M	-	-	-	▲0.117	
1Y	-	-	-	▲0.146	

無担保コール(速報)は日銀、東京レボレートは日本証券業協会公表

12月29日の予定 (時刻は日本時間)

日本		予想		海外		予想	
特になし				特になし			
-				-			
-				-			

経済指標及び予想値は株式会社フィスコ提供

本日の市況

本日の無担保コールON物は▲0.012%の出合から始まった。
 その後は主に▲0.015%~▲0.010%の水準で出合が見られた。
 金融機関の調達ニーズは前営業日に比べてやや落ち着き、
 同加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.003%の▲0.019%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.050 ~ ▲0.045	▲0.013 ~ ▲0.013	▲0.035 ~ ▲0.010

翌営業日のマーケット

ビットサイドの調達ニーズは本日と同様で、出合いの水準は横ばいを予想。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	12月28日	12月29日	12月29日	12月30日	12月28日	12月29日
券		▲3,000		▲2,600		▲600
財政		▲3,200		▲3,800		▲1,900
過不足		▲6,200		▲6,400		▲2,500
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
国債買入		+10,100				
共通担保(全店)	▲3,500	+4,700				+6,000
CP等買入	▲800		▲600			
国債補完供給		▲100	+100			
当座預金増減		+4,200		▲6,900		+3,500
当座預金残高		4,956,200		4,949,300		4,952,800
準備預金残高		4,347,500	主な需給要因			
積み終了先		4,347,200				
超過準備		4,347,200				
非準備先残高		608,700				
準備預金進捗率		99.9%				
平均		41.9%				
乖離率		58.0%				

12月28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(12/28~12/29)	119	119	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マネタリーベース (億円)

12月25日時点 6,179,600

所要

今積期の所要準備額 3,581,400

12月29日以降の残り所要

積数 1,600

平均 100

国庫短期証券入札予定

1月5日	3ヶ月	第962回
1月7日	6ヶ月	第963回
1月8日	3ヶ月	第964回
1月15日	3ヶ月	

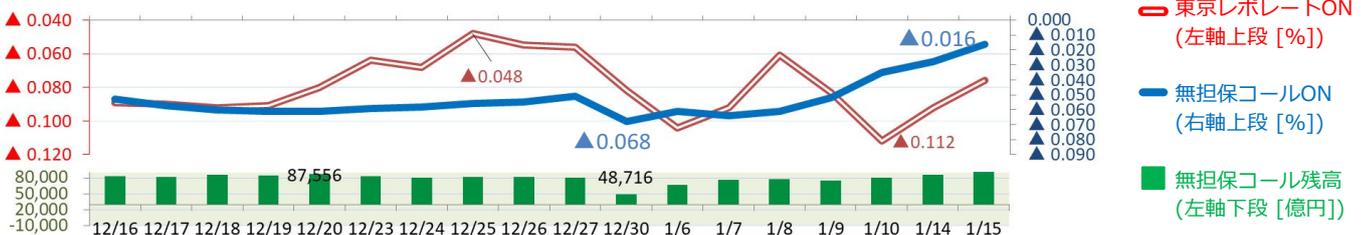
今月の国債買入オペ予定

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25日	0
5年超10年以下	2,500~6,000	4,200	4 11 16 21 25	12月25日	0
10年超25年以下	500~2,000	1,200	4 25	12月25日	0
25年超	0~500	300	7 25	12月25日	0
物価運動債	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	-

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