



短期市場の推移

	12月23日	12月24日	12月25日	12月28日
加重平均金利	▲0.019	▲0.021	▲0.016	▲0.019
東京レポレート(TN)	▲0.089	▲0.085	▲0.085	▲0.081
無コール残	109,090	113,897	118,031	109,685
ON	62,532	67,119	72,503	66,007
その他	46,558	46,778	45,528	43,678
有コール残	23,673	23,118	21,963	23,723

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。
 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	▲0.065	0.001	▲0.019	▲0.074
T/N	-	-	▲0.017	▲0.079
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	▲0.013	▲0.082
2W	▲0.025	▲0.003	▲0.019	▲0.086
3W	-	-	-	▲0.090
1M	-	-	0.001	▲0.094
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.100
6M	-	-	-	▲0.116
1Y	-	-	-	▲0.146

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

12月30日の予定 (時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
11:00	決済動向(11月)	-	23:45	(米)12月MNIシカゴ購買部協会景気指数	56.5
	-			-	
	-			-	

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。昨日に引き続き地銀業態の調達ニーズが強く、同加重平均金利(速報)は前営業日対比横ばいの▲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

年末初物となるため、一部調達を控える動きが予想される。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	12月29日	12月30日	12月30日	12月31日	1月4日	1月4日
券	▲2,800	▲400				+6,000
財政	▲6,300	▲3,800				▲18,000
過不足	▲9,100	▲4,200				▲12,000
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
CP等買入	▲600		▲4,100		+6,000	
E T F 買入					+500	
国債補完供給	+100	▲200	+200			
当座預金増減	▲9,800	▲1,600	▲1,600		▲12,000	
当座預金残高	4,946,400	4,944,800	4,944,800		4,932,800	
準備預金残高	4,363,000					
積み終了先	4,362,600					
超過準備	4,362,600					
非準備先残高	583,400					
準備預金進捗率	99.9%					
平均	45.2%					
乖離率	54.7%					

12月29日のオペ結果

オペ種類 オファー 応札 落札 足切 平均 按分

国債補完供給(12/29~12/30)	168	168	▲0.350	▲0.350
	0	0		

マネタリーベース [億円]
 12月28日時点 6,186,900

所要	所要準備額	積数	平均
今積期の所要準備額	3,581,400		
12月30日以降の残り所要		1,300	
		平均	100

国債短期証券入札予定

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	

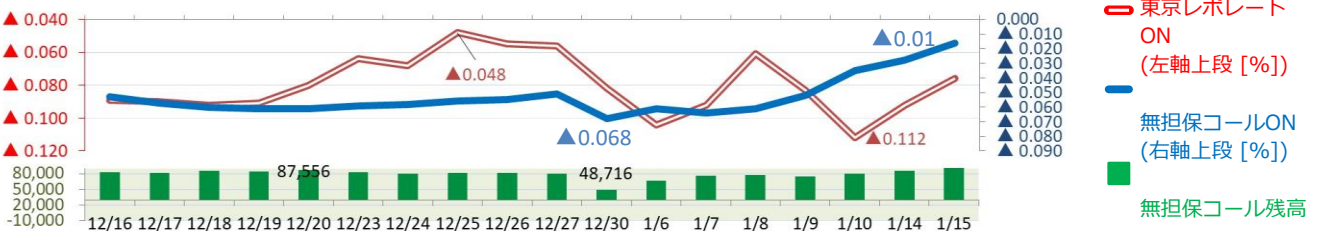
今月の国債買入オペ予定

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