

短期市場の推移

	12月13日	12月16日	12月17日	12月18日
加重平均金利	▲0.008	▲0.053	▲0.057	▲0.060
東京レポレート(ON)	▲0.020	▲0.089	▲0.090	▲0.092
無コール残	60,202	82,865	82,098	85,051
ON	39,142	57,790	56,073	58,231
その他	21,060	25,075	26,025	26,820
有コール残	19,219	22,217	21,904	22,078

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20日の予定(時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
全国CPI(前年比)(11月)		18:30 (英)7-9月期国内総生産(GDP)改定値[前年比]	1.0%
-		22:30 (米)7-9月期国内総生産(GDP)確報値[前期比年率]	2.1%
-		-	-

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	▲0.087	0.001	▲0.061	▲0.091
T/N	-	-	-	▲0.095
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	▲0.040	▲0.096
2W	-	-	-	▲0.108
3W	-	-	-	▲0.108
1M	-	-	0.000	▲0.105
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.110
6M	-	-	-	▲0.157
1Y	-	-	-	▲0.178

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▲0.060%の出合から始まり、その後は▲0.087%~▲0.045%の水準で取引された。昨日同様ビッドサイドは慎重な調達姿勢となり、同加重平均金利(速報)は前日対比▲0.001%の▲0.061%となった。
本日結果が公表された金融政策決定会合では政策の現状維持が決定された。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.087 ~ ▲0.087	- ~ -	▲0.087 ~ ▲0.040

翌営業日のマーケット

週末3日積みとなることから調達ニーズは強まり、強含むと予想。

資金需給

	日銀速報	日銀予想	当社需給予想
	12月19日	12月20日	12月23日
券	▲3,900	▲3,200	▲2,000
財政	+200	+80,500	▲6,000
過不足	▲3,700	+77,300	▲8,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国債買入	+11,300		
CP等買入	▲200	▲800	
社債等買入		▲600	
ETF買入			+900
被災地金融機関支援		▲100	+100
国債補完供給	+100	▲500	+500
当座預金増減	+7,000	+77,300	▲8,000
当座預金残高	3,969,000	4,046,300	4,038,300
準備預金残高	3,449,200	主な需給要因	
積み終了先	3,434,400	国庫短期証券発行・償還(1Y)	
超過準備	3,430,400	国債償還(5年・10年・個人)	
非準備先残高	519,800	国庫短期証券発行・償還(3M)	
準備預金進捗率	99.2%		
平均	12.9%		
乖離率	86.3%		

12月19日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	接分
国債補完供給(12/19~12/20)	537	537	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マナタリーベース [億円]	所要 [億円]
12月18日時点 5,111,400	今積期の所要準備額 3,227,400
	12月20日以降の残り所要積数 25,300
	平均 900

国庫短期証券入札予定

12月20日	3ヶ月	第8/8回
1月7日	3ヶ月	
1月9日	6ヶ月	
1月10日	3ヶ月	
12月24日	2年	
1月7日	10年	
1月9日	30年	
1月15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	100~1,000 程度	500	月2回程度	12月9日	1
1年超3年以下	3,000~5,500 程度	4,200			
3年超5年以下	2,000~4,500 程度	3,400	2 6 13 18	12月18日	0
5年超10年以下	2,000~5,000 程度	3,500	6 13 18 25	12月18日	1
10年超25年以下	500~1,500 程度	1,000			
25年超	0~500 程度	300	2 9 25	12月9日	1
物価連動債	300 程度	300	月2回程度	12月13日	0
変動利付債<偶数月>	1,000 程度	1,000	-	12月9日	-

1年前の市場推移

○2018年12月積み期 [12月14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。投資については最終決定は、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。