

短期市場の推移

	12月16日	12月17日	12月18日	12月19日
加重平均金利	▲0.053	▲0.057	▲0.060	▲0.061
東京レポレート(ON)	▲0.089	▲0.090	▲0.092	▲0.091
無コール残	82,865	82,098	85,051	84,758
ON	57,790	56,073	58,231	56,818
その他	25,075	26,025	26,820	27,940
有コール残	22,217	21,904	22,078	23,826

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23日の予定(時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
14:00頃 実質輸出入の動向(詳細)	-	22:30 (米)11月耐久財受注[前月比]	1.5%
-	-	22:30 (米)11月シカゴ連銀全米活動指数	-
-	-	-	-

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	▲0.080
T/N	-	-	-	▲0.070
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.050	0.001	▲0.029	▲0.074
2W	-	-	-	▲0.091
3W	-	-	-	▲0.090
1M	-	-	-	▲0.093
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.102
6M	-	-	-	▲0.156
1Y	-	-	-	▲0.176

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%を中心に取引された。3日積みであったが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)は前日対比横ばいの▲0.061%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.087 ~ ▲0.087	- ~ -	▲0.087 ~ ▲0.045

翌営業日のマーケット

出合の水準は小幅上昇を予想する。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	12月20日	12月23日	12月23日	12月24日	12月24日	12月24日
券	▲3,100	▲2,900	▲2,900	▲3,000	▲3,000	▲3,000
財政	+78,000	▲13,500	▲13,500	▲6,000	▲6,000	▲6,000
過不足	+74,900	▲16,400	▲16,400	▲9,000	▲9,000	▲9,000
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	▲800	▲300	▲300	-	-	-
社債等買入	▲600	-	-	+800	+800	+800
ETF買入	+900	-	-	-	-	-
被災地金融機関支援	▲100	+100	+100	-	-	-
国債補完供給	+500	▲1,200	+1,200	-	-	-
当座預金増減	+73,700	▲15,500	▲15,500	▲8,200	▲8,200	▲8,200
当座預金残高	4,042,700	4,027,200	4,027,200	4,019,000	4,019,000	4,019,000
準備預金残高	3,521,500	主な需給要因				
積み終了先	3,520,700					
超過準備	3,518,000					
非準預先残高	521,200	国庫短期証券発行・償還(3M)				
準備預金進捗率	99.5%					
平均	22.6%					
乖離率	77.0%					

12月20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
国債補完供給(12/20~12/23)	1,152	1,152	▲0.350	▲0.350		

マナタリーベース [億円]
12月19日時点 5,122,300

所要 [億円]
今積期の所要準備額 3,227,400
12月23日以降の残り所要積数 14,800
平均 600

国庫短期証券入札予定

1月7日	3ヶ月
1月9日	6ヶ月
1月10日	3ヶ月
1月16日	1年
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	2	6	13	18	12月18日	0
3年超5年以下	2,000~4,500 程度	3,400	6	13	18	25	12月18日	1
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	2	9	25	12月9日	1	
25年超	0~500 程度	300	月2回程度	12月13日	0			
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。