

短期市場の推移

	12月18日	12月19日	12月20日	12月23日
加重平均金利	▲0.060	▲0.061	▲0.061	▲0.059
東京レポレート(ON)	▲0.092	▲0.091	▲0.080	▲0.064
無コール残	85,051	84,758	87,556	83,620
ON	58,231	56,818	58,071	52,365
その他	26,820	27,940	29,485	31,255
有コール残	22,078	23,826	27,475	22,921

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25日の予定(時刻は日本時間)

時刻	日本	予想	海外	予想
8:50	預金種別別店頭表示金利の平均年利率等	-	(米)休場(クリスマス)	-
8:50	企業向けサービス価格指数(11月)	-	-	-

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	▲0.058	▲0.068
T/N	-	-	-	▲0.072
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	-	▲0.087
2W	-	-	-	▲0.085
3W	-	-	-	▲0.083
1M	-	-	-	▲0.084
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.100
6M	-	-	-	▲0.150
1Y	-	-	-	▲0.169

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%の出合から始まった。その後は主に▲0.087%~▲0.040%の水準で取引された。同加重平均金利(速報)は前日対比+0.001%の▲0.058%となった。

都銀・信託		証券	地銀
▲0.087 ~ ▲0.087		▲0.080 ~ ▲0.080	▲0.087 ~ ▲0.040

翌営業日のマーケット

調達サイドの動向に大きな変化はなく、出合いの水準は横ばい圏と予想する。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	12月24日	12月25日	12月25日	12月26日	12月26日	12月27日
券	▲3,600	▲3,600	▲3,600	▲4,000	▲4,000	▲4,000
財政	▲100	▲3,000	▲3,000	▲2,000	▲2,000	▲2,000
過不足	▲3,700	▲6,600	▲6,600	▲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				+5,000		
CP等買入	▲200	▲200	▲200			
社債等買入	+800	▲200	▲200			
ETF買入	+500					
国債補完供給	+1,000	▲100	+100			
当座預金増減	▲1,700	▲1,900	▲1,900	▲6,000	▲6,000	▲6,000
当座預金残高	4,023,500	4,021,600	4,021,600	4,015,600	4,015,600	4,015,600
準備預金残高	3,498,000	主な需給要因				
積み終了先	3,497,000					
超過準備	3,497,000					
非率預先残高	525,500					
準備預金進捗率	99.6%					
平均	29.0%					
乖離率	70.6%					

12月24日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	接分
国庫短期証券買入(12/25~)	5,000	15,958	5,000	0.022	0.038	40.9
米ドル資金供給(12/27~1/9)	0	0	2,070	2,070		
国債補完供給(12/24~12/25)	40	40	▲0.350	▲0.350		
	38	38	▲0.350	▲0.350		

マナタリーベース	所要
12月23日時点 5,184,700	今積期の所要準備額 3,227,400
	12月25日以降の残り所要積数 12,500
	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
1月7日	10年
1月9日	30年
1月15日	5年
1月17日	20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。