

短期市場の推移

	12月24日	12月25日	12月26日	12月27日
加重平均金利	▲0.058	▲0.056	▲0.055	▲0.051
東京レポレート(ON)	▲0.068	▲0.048	▲0.055	▲0.056
無コール残	80,302	81,346	81,072	79,941
ON	48,137	49,181	48,657	49,076
その他	32,165	32,165	32,415	30,865
有コール残	23,494	24,096	20,862	20,722

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。

1月6日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
13:00 日銀当座預金増減要因と金融調節(12月実績)	-	19:00 (欧)11月生産者物価指数[前年比]	-1.7%
-	-	-	-
-	-	-	-

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	▲0.068	▲0.082
T/N	-	-	-	▲0.073
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.030	▲0.025	▲0.027	▲0.072
2W	-	-	-	▲0.076
3W	-	-	-	▲0.080
1M	-	-	▲0.004	▲0.086
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.100
6M	-	-	-	▲0.145
1Y	-	-	-	▲0.164

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

年末初ものとなる本日の無担保コールON物は▲0.087%の出合いから始まった。その後は主に▲0.087%~▲0.05%の水準で取引された。同加重平均金利は前営業日対比▲0.017%となる▲0.068%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.087 ~ ▲0.087	- ~ -	▲0.087 ~ ▲0.050

翌営業日のマーケット

年末初で調達を控えたビッドが戻ってくる見込みであるものの、慎重な動き出しとなる事が予想されるため、引き続き軟調な地合いで推移する見込み。

資金需給

	日銀速報 12月30日	日銀予想 1月6日	当社需給予想 1月7日
券	▲900	+6,200	+5,000
財政	▲8,800	▲23,600	▲2,000
過不足	▲9,700	▲17,400	+3,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
CP等買入	▲800	+2,500	-
国債補充供給	▲900	+900	-
当座預金増減	▲8,900	▲16,500	+3,000
当座預金残高	4,005,500	3,989,000	3,992,000
準備預金残高	3,477,600	主な需給要因	
積み終了先	3,477,300	国債発行(2年)	
超過準備	3,476,700		
非準預先残高	527,900		
準備預金進捗率	99.9%		
平均	67.7%		
乖離率	32.2%		

12月30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
国債補充供給(12/30~1/6)	892	892	▲0.350	▲0.350		

マナタリーベース [億円]	所要 [億円]
12月27日時点 5,190,400	今積期の所要準備額 3,226,800
	1月6日以降の残り所要積数 2,200
	平均 200

国庫短期証券入札予定

1月7日	3ヶ月	第879回
1月9日	6ヶ月	第880回
1月10日	3ヶ月	第881回
1月16日	1年	第882回
1月7日	10年	
1月9日	30年	
1月15日	5年	
1月17日	20年	

来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25日	2
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	6 10 20 29	12月18日	4
5年超10年以下	2,000~5,000 程度	3,500	10 16 23 29	12月25日	4
10年超25年以下	500~1,500 程度	1,000			
25年超	0~500 程度	300	6 14 23	12月25日	3
物価運動債	300 程度	300	月2回程度	12月13日	2
変動利付債<偶数月>	1,000 程度	1,000	-	12月9日	0

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。