

短期市場の推移

	11月28日	11月29日	11月30日	12月3日
加重平均金利	▲0.070	▲0.072	▲0.062	▲0.069
東京レポレート(ON)	▲0.122	▲0.122	▲0.102	▲0.091
無コール残	78,868	81,763	69,361	66,414
ON	47,078	49,033	38,691	37,124
その他	31,790	32,730	30,670	29,290
有コール残	18,016	19,597	19,623	28,346

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5日の予定(時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
8:50	日銀当座預金増減要因(12月見込み)	-	22:15	(米)11月ADP全米雇用報告	20.0万人
10:30	【挨拶・講演】若田部副総裁(新潟)	-		(米)ページブック	-
				(米)パウエルFRB議長の議会証言	-

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	▲0.150	0.001	▲0.069	▲0.092
T/N	-	-	▲0.015	▲0.096
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	▲0.035	▲0.107
2W	-	-	▲0.040	▲0.113
3W	-	-	-	▲0.130
1M	0.360	0.480	0.420	▲0.162
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.159
6M	-	-	-	▲0.159
1Y	-	-	-	▲0.159

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▲0.086%の出合から始まった。その後は▲0.086%~▲0.040%の水準で取引された。同加重平均金利は前営業日対比横ばいの▲0.069%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.086 ~ ▲0.086	-	▲0.086 ~ ▲0.040

翌営業日のマーケット

明日もビッドサイドの調達姿勢は変わらず、本日も同様の軟調な地合になると予想する。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	12月4日	12月5日	12月4日	12月5日	12月6日	12月7日
券	▲1,000	▲1,400	▲1,000	▲1,400	▲2,000	▲2,000
財政	▲79,600	▲27,000	▲79,600	▲27,000	+3,000	+3,000
過不足	▲80,600	▲28,400	▲80,600	▲28,400	+1,000	+1,000
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				+1,000		
国債買入	+8,300		+8,300			
CP等買入	▲300	▲100	▲300	▲100		
社債等買入	▲100		▲100			
国債補完供給	+700	▲800	+700	+800		
当座預金増減	▲72,800	▲26,700	▲72,800	▲26,700	+1,000	+1,000
当座預金残高	3,804,600	3,777,900	3,804,600	3,777,900	3,778,900	3,778,900
準備預金残高	3,329,500		3,329,500			
積み終了先	3,329,400		3,329,400			
超過準備	3,329,400		3,329,400			
非率預先残高	475,100		475,100			
準備預金進捗率	99.9%		99.9%			
平均	63.3%		63.3%			
乖離率	36.6%		36.6%			

12月4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
国庫短期証券買入(12/5~)	1,000	7,362	1,000	0.036	0.048	
米ドル資金供給(12/6~12/13)			1	2.710	2.710	
CP等買入(12/7~)	2,000	6,247	1,981	▲0.002	0.001	16.5
国債補完供給(12/4~12/5)	79,945	688	688	▲0.600	▲0.600	
	10,000	68	68	▲0.600	▲0.600	

マナタリーベース [億円]	所要 [億円]
12月3日時点 4,981,800	今積期の所要準備額 3,008,500
	12月5日以降の残り所要積数 1,900
	平均 200

国庫短期証券入札予定

12月6日	6ヶ月	第800回
12月7日	3ヶ月	第801回
12月14日	3ヶ月	
12月19日	1年	
12月11日	30年	
12月13日	5年	
12月18日	20年	
12月26日	2年	

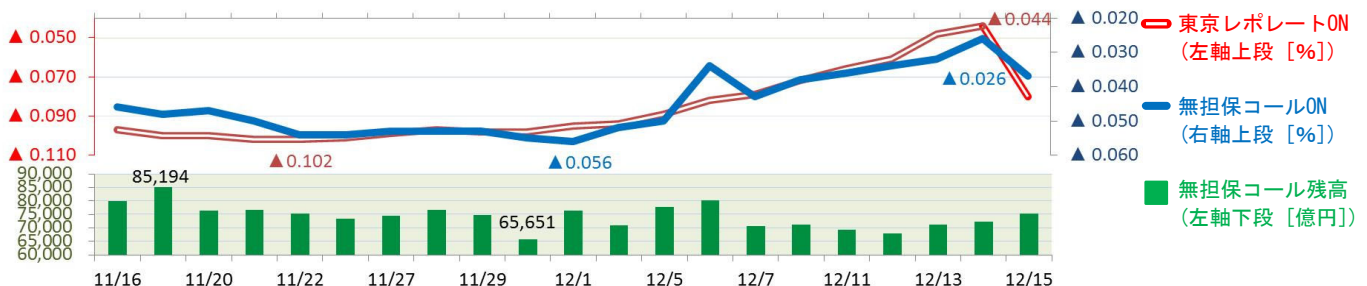
今月の国債買入オペ予定

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3日	1
1年超3年以下	2,500~4,500 程度	3,500			
3年超5年以下	3,000~5,500 程度	4,000	3 10 17 25	12月3日	3
5年超10年以下	3,000~6,000 程度	4,500	5 10 14 19 27	11月30日	5
10年超25年以下	1,500~2,500 程度	1,800			
25年超	100~1,000 程度	500	5 14 25 27	11月30日	4
物価連動債	250 程度	250	月2回程度	11月28日	2
変動利付債<偶数月>	1,000 程度	1,000	1回	10月17日	1

1年前の市場推移

○2017年11月積み期 [11月16日~12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。