

短期市場の推移

	12月3日	12月4日	12月5日	12月6日
加重平均金利	▲0.028	▲0.025	▲0.017	▲0.009
東京レポレート(ON)	▲0.052	▲0.049	▲0.038	▲0.035
無コール残	71,011	72,947	74,233	74,411
ON	47,751	49,047	50,188	51,576
その他	23,260	23,900	24,045	22,835
有コール残	20,570	19,989	19,996	19,512

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10日の予定(時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	18:30 (英)10月鉱工業生産指数 [前月比]	0.3%
-	-	18:30 (英)10月商品貿易収支	-115億ポンド
-	-	(米)FOMC(11日まで)	

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	▲0.050	0.001	▲0.008	▲0.024
T/N	-	-	-	▲0.017
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.030	▲0.007	▲0.017	▲0.031
2W	-	-	0.000	▲0.048
3W	-	-	-	▲0.085
1M	-	-	-	▲0.091
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.104
6M	-	-	-	▲0.159
1Y	-	-	-	▲0.184

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▲0.010%の出会いから始まった。その後は、主に▲0.015%~▲0.005%の水準で取引された。同加重平均金利は前日対比+0.001%の▲0.008%(速報)と、2016年4月以来約3年6か月ぶりの高水準となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.015 ~ ▲0.010	▲0.010 ~ ▲0.005	▲0.010 ~ ▲0.005

翌営業日のマーケット

引き続きビッドサイドの調達ニーズは強く、地合いは横ばいを予想。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	12月9日	12月10日	12月9日	12月10日	12月11日	12月12日
券	▲800	▲1,600	▲800	▲1,600	▲2,000	▲2,000
財政	▲1,300	▲3,000	▲1,300	▲3,000	▲22,000	▲22,000
過不足	▲2,100	▲4,600	▲2,100	▲4,600	▲24,000	▲24,000
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
国債買入	+11,900	+3,000	+11,900	+3,000		
共通担保(全店)	▲6,200	+5,800	▲6,200	+5,800		
CP等買入	▲100	▲500	▲100	▲500		
社債等買入	▲300		▲300			
ETF買入					+200	
国債補完供給	+600		+600			
当座預金増減	+9,600	▲1,900	+9,600	▲1,900	▲24,000	▲24,000
当座預金残高	3,926,300	3,924,400	3,926,300	3,924,400	3,900,400	3,900,400
準備預金残高	3,410,100		3,410,100			
積み終了先	3,409,900		3,409,900			
超過準備	3,409,900		3,409,900			
非準預先残高	516,200		516,200			
準備預金進捗率	99.9%		99.9%			
平均	80.0%		80.0%			
乖離率	19.9%		19.9%			

12月9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
国債買入(12/10~)						
~1年	500	1,267	501	0.013	0.043	80.0
10~25年	1,000	2,973	1,005	0.008	0.010	16.2
25年~	300	1,026	304	0.010	0.011	33.5
変動利付	1,000	3,564	1,001	▲0.240	▲0.254	25.0
国債補完供給(12/9~12/10)						
		0	0			
		27	27	▲0.250	▲0.250	

マナタリーベース [億円]
12月6日時点 5,049,200

所要 [億円]
今積期の所要準備額 3,117,600
12月10日以降の残り所要
積数 1,200
平均 200

国庫短期証券入札予定

12月13日	3ヶ月	第876回
12月18日	1年	
12月20日	3ヶ月	
1月7日	3ヶ月	
国債入札予定		
12月10日	5年	
12月17日	20年	
12月24日	2年	
1月7日	10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6日	2
5年超10年以下	2,000~5,000 程度	3,500	6 13 18 25	12月6日	3
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6日	1
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11月積み期 [11月16日~12月14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。