

短期市場の推移

	12月6日	12月9日	12月10日	12月11日
加重平均金利	▲0.009	▲0.008	▲0.008	▲0.008
東京レポレート(ON)	▲0.035	▲0.024	▲0.018	▲0.008
無コール残	74,411	71,372	76,810	72,595
ON	51,576	49,102	54,560	49,785
その他	22,835	22,270	22,250	22,810
有コール残	19,512	19,870	19,306	18,956

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13日の予定(時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
8:50	10-12月期日銀短観 (大企業製造業DI)	3	22:30	(米)11月小売売上高	0.4%
-	【記者会見】 両宮日銀副総裁 (12月12日)	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-

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	▲0.040	0.001	▲0.009	▲0.003
T/N	-	-	-	▲0.003
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.020	0.000	▲0.017	▲0.031
2W	▲0.040	▲0.020	▲0.027	▲0.062
3W	-	-	-	▲0.087
1M	-	-	-	▲0.090
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.103
6M	-	-	-	▲0.158
1Y	-	-	-	▲0.182

無担保コール(速報)は日銀、東京レポレートは日本証券協会公表

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▲0.010%~▲0.005%の水準で取引された。同加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.001%の▲0.009%となった。

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

翌営業日のマーケット

週末3日積みかつ積み最終日となるため、引き続き堅調な地合を予想。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	12月12日	12月13日	12月12日	12月13日	12月16日	12月17日
券	▲3,300	▲2,700	▲3,300	▲2,700	▲2,000	▲2,000
財政	+2,500	+70,000	+2,500	+70,000	+6,000	+6,000
過不足	▲800	+67,300	▲800	+67,300	+4,000	+4,000
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		+2,000				
CP等買入	▲300		▲500			
社債等買入	▲100					
国債補完供給	▲100	+100				
貸出増加支援					▲20,000	+20,600
当座預金増減	+700	+66,900	+700	+66,900	+4,600	+4,600
当座預金残高	3,896,300	3,963,200	3,896,300	3,963,200	3,967,800	3,967,800
準備預金残高	3,381,500		3,381,500			
積み終了先	3,381,300		3,381,300			
超過準備	3,381,300		3,381,300			
非準備先残高	514,800		514,800			
準備預金進捗率	99.9%		99.9%			
平均	90.0%		90.0%			
乖離率	9.9%		9.9%			

12月12日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	接分
国債補完供給(12/12~12/13)	105	105	▲0.250	▲0.250		

マナタリーベース [億円]
12月11日時点 5,032,300

所要 [億円]
今積期の所要準備額 3,117,600
12月13日以降の残り所要
積数 500
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	第877回
12月20日	3ヶ月	
1月7日	3ヶ月	
12月17日	20年	
12月24日	2年	
1月7日	10年	
1月9日	30年	

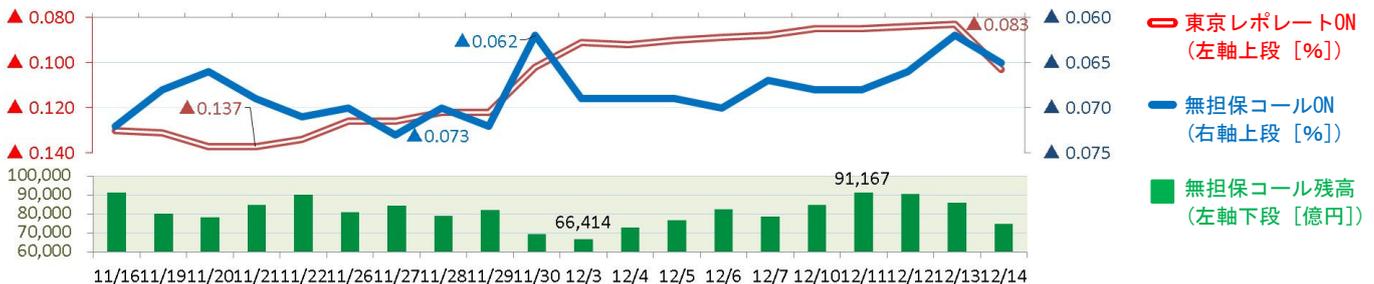
今月の国債買入オペ予定

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。 上田八木短資株式会社 登録金融機関 近畿財務局長(登号)第243号 加入協会 日本証券業協会