

短期市場の推移

	12月11日	12月12日	12月13日	12月16日
加重平均金利	▲0.008	▲0.009	▲0.008	▲0.053
東京レポレート(ON)	▲0.008	▲0.003	▲0.020	▲0.089
無コール残	72,595	69,399	60,202	82,865
ON	49,785	46,489	39,142	57,790
その他	22,810	22,910	21,060	25,075
有コール残	18,956	18,851	19,219	22,217

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18日の予定(時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
	日銀金融政策決定会合(1日目)		(米) ショコ連銀総裁講演	
8:50	11月貿易収支	-3500億円	(欧) CPI(11月)(確報)	

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	▲0.057	▲0.090
T/N	-	-	-	▲0.095
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	▲0.030	▲0.097
2W	-	-	-	▲0.110
3W	-	-	▲0.025	▲0.109
1M	-	-	-	▲0.107
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.115
6M	-	-	-	▲0.160
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%の出合から始まり、その後は▲0.060%~▲0.050%を中心に取引された。昨日同様ビッドサイドは慎重な調達姿勢となり、同加重平均金利(速報)は前日対比▲0.006%の▲0.057%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.087 ~ ▲0.087	▲0.070 ~ ▲0.070	▲0.080 ~ ▲0.040

翌営業日のマーケット

調達サイドの動向に変化はなく、出合の水準は横ばいと予想する。

資金需給

	日銀速報 12月17日	日銀予想 12月18日	当社需給予想 12月19日
券	▲2,300	▲2,500	▲4,000
財政	▲400	▲10,800	+2,000
過不足	▲2,700	▲13,300	▲2,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国庫短期証券買入		+1,000	
CP等買入	▲200	▲100	
国債補完供給	+100	+200	
当座預金増減	▲3,000	▲9,700	▲2,000
当座預金残高	3,974,500	3,964,800	3,962,800
準備預金残高	3,454,600	主な需給要因	
積み終了先	3,358,100		
超過準備	2,921,500		
非準預先残高	519,900	国債発行(20年)	
準備預金進捗率	96.7%		
平均	6.5%		
乖離率	90.3%		

12月17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(12/18~)	1,000	7,583	1,000	0.022	0.025	21.1
米ドル資金供給(12/19~12/27)		1	1	2.040	2.040	
国債補完供給(12/17~12/18)		226	226	▲0.350	▲0.350	

マナタリーベース [億円]
12月16日時点 5,122,100

所要 [億円]
今積期の所要準備額 3,227,400
12月18日以降の残り所要積数 105,900
平均 3.700

国庫短期証券入札予定

12月18日	1年	第877回
12月20日	3ヶ月	第878回
1月7日	3ヶ月	
1月9日	6ヶ月	
12月24日	2年	
1月7日	10年	
1月9日	30年	
1月15日	5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13日	1
5年超10年以下	2,000~5,000 程度	3,500	6 13 18 25	12月13日	2
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	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。