

短期市場の推移

	11月27日	11月28日	11月29日	11月30日
加重平均金利	▲0.073	▲0.070	▲0.072	▲0.062
東京レポレート(ON)	▲0.126	▲0.122	▲0.122	▲0.102
無コール残	84,394	78,868	81,763	69,361
ON	52,404	47,078	49,033	38,691
その他	31,990	31,790	32,730	30,670
有コール残	15,422	18,016	19,597	19,623

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4日の予定(時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
8:50	マネタリーベース(11月)	-	EU財務相理事会	
10:00	営業毎旬報告(11月30日現在)	-	(米)ウィリアムズNY連銀総裁挨拶	

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	▲0.091
T/N	-	-	▲0.015	▲0.094
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	▲0.020	▲0.105
2W	▲0.038	▲0.010	▲0.034	▲0.110
3W	-	-	-	▲0.126
1M	-	-	▲0.020	▲0.162
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.156
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

無担保コールON物は▲0.086%の出合から始まったものの、先週末同様に資金調達を控える先が多く、▲0.086%のオファーが出し残る展開となった。同加重平均金利は前営業日対比▲0.007%の▲0.069%となった。

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

翌営業日のマーケット

税揚げによって地銀のビッドが増える可能性があるものの、大きく取りあがる動きにはならないと予想する。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	12月3日	12月4日	12月4日	12月5日	12月5日	12月6日
券	▲600	▲1,000	▲1,000	▲1,000	▲1,000	▲1,000
財政	▲41,500	▲78,400	▲78,400	▲22,000	▲22,000	▲22,000
過不足	▲42,100	▲79,400	▲79,400	▲23,000	▲23,000	▲23,000
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		+7,200	+8,300			
共通担保(全店)	▲1,500	+1,900				
CP等買入	▲100		▲300			
社債等買入			▲100			
国債補完供給	+2,600	▲700	+700			
成長基盤強化支援	▲6,900	+4,100				
当座預金増減	▲35,500	▲70,800	▲70,800	▲23,000	▲23,000	▲23,000
当座預金残高	3,877,400	3,806,600	3,806,600	3,783,600	3,783,600	3,783,600
準備預金残高	3,412,600					
積み終了先	3,412,300					
超過準備	3,412,300					
非準備先残高	464,800					
準備預金進捗率	99.9%					
平均	60.0%					
乖離率	39.9%					

12月3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(12/4~)						
~1年	500	1,857	501	0.013	0.019	59.1
1~3年	3,500	8,517	3,509	0.001	0.002	27.0
3~5年	4,000	6,529	4,008	▲0.003	▲0.002	99.3
国債補完供給(12/3~12/4)						
	198,360	697	697	▲0.600	▲0.600	
	12,536	0	0			

マネタリーベース [億円]	所要 [億円]
11月30日時点 5,016,700	今積期の所要準備額 3,008,500
	12月4日以降の残り所要積数 2,000
	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4日	10年	
12月11日	30年	
12月13日	5年	
12月18日	20年	

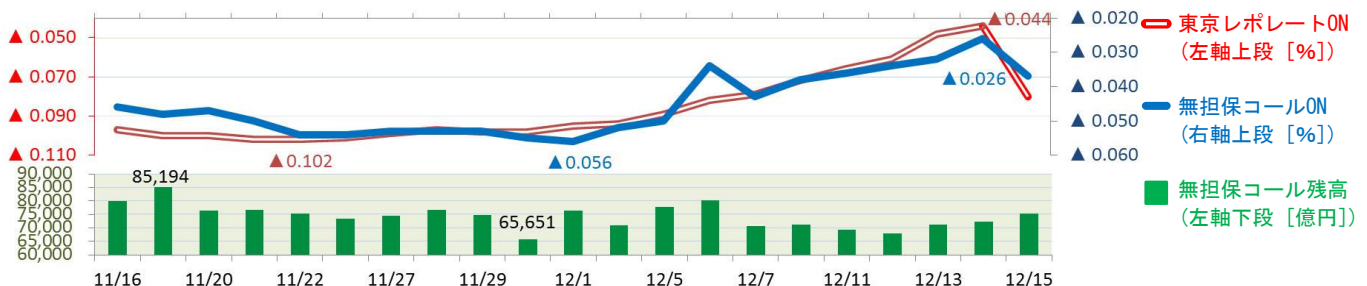
今月の国債買入オペ予定

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。