

短期市場の推移

	11月29日	11月30日	12月3日	12月4日
加重平均金利	▲0.072	▲0.062	▲0.069	▲0.069
東京レポレート(ON)	▲0.122	▲0.102	▲0.091	▲0.092
無コール残	81,763	69,361	66,414	72,531
ON	49,033	38,691	37,124	42,961
その他	32,730	30,670	29,290	29,570
有コール残	19,597	19,623	28,346	27,011

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6日の予定(時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
【記者会見】 若田部副総裁(12月5日)	-	0:00 (米)11月ISM非製造業 景況指数	59.5
-	-	22:30 (米)新規失業保険 申請件数[前週分]	-
-	-	(米)パウエルFRB 議長講演(住宅会議)	-

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	▲0.086	0.001	▲0.069	▲0.090
T/N	-	-	▲0.015	▲0.099
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	▲0.038	▲0.106
2W	-	-	▲0.010	▲0.113
3W	-	-	▲0.035	▲0.129
1M	-	-	-	▲0.166
2M	-	-	▲0.010	-
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

ビッドサイドの調達姿勢は大きく変わらず、軟調な地合が継続すると予想する。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	12月5日	12月6日	12月6日	12月7日	12月7日	12月8日
券	▲1,400	▲2,200	▲1,400	▲2,200	▲1,400	▲2,200
財政	▲27,300	+2,700	▲27,300	+2,700	▲27,300	+2,700
過不足	▲28,700	+500	▲28,700	+500	▲28,700	+500
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				+7,600		
CP等買入	▲100		▲100		▲100	
国債補完供給	+800	▲900	+900		+2,000	
当座預金増減	▲27,900	+8,900	▲27,900	+8,900	▲27,900	+8,900
当座預金残高	3,776,700	3,785,600	3,776,700	3,785,600	3,776,700	3,785,600
準備預金残高	3,309,800	3,309,800	3,309,800	3,309,800	3,309,800	3,309,800
積み終了先	3,309,600		3,309,600		3,309,600	
超過準備	3,309,600		3,309,600		3,309,600	
非準預先残高	466,900		466,900		466,900	
準備預金進捗率	99.9%		99.9%		99.9%	
平均	66.7%		66.7%		66.7%	
乖離率	33.2%		33.2%		33.2%	

12月5日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	接分
国債買入(12/6~)						
5~10年	4,500	8,528	4,501	▲0.016	▲0.014	23.4
10~25年	2,000	5,181	2,009	▲0.012	▲0.010	59.5
25年~	500	1,681	506	▲0.013	▲0.012	17.2
物価連動	250	1,223	253	▲0.120	▲0.141	88.6
国債補完供給(12/5~12/6)						
	113,440	908	908	▲0.600	▲0.600	

マナタリーベース	所要
12月4日時点 4,910,100	今積期の所要準備額 3,008,500
	12月6日以降の残り所要積数 1,700
	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	

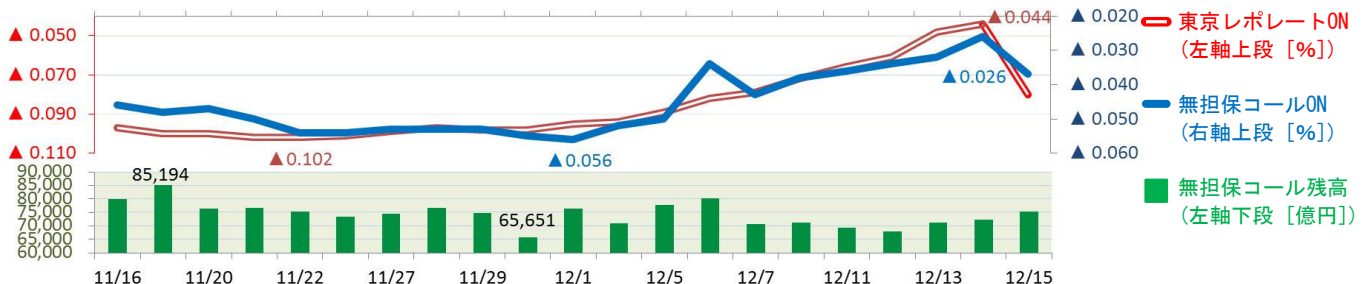
今月の国債買入オペ予定

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	12月5日	4
10年超25年以下	1,500~2,500 程度	2,000			
25年超	100~1,000 程度	500	5 14 25 27	12月5日	3
物価連動債	250 程度	250	月2回程度	12月5日	1
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。