

短期市場の推移

[億円] [%]

	11月30日	12月3日	12月4日	12月5日
加重平均金利	▲0.062	▲0.069	▲0.069	▲0.069
東京レポレート(ON)	▲0.102	▲0.091	▲0.092	▲0.090
無コール残	69,361	66,414	72,531	76,574
ON	38,691	37,124	42,961	46,904
その他	30,670	29,290	29,570	29,670
有コール残	19,623	28,346	27,011	35,298

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。

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	▲0.070	▲0.089
T/N	-	-	▲0.015	▲0.096
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.045	0.001	▲0.037	▲0.103
2W	-	-	▲0.045	▲0.120
3W	-	-	-	▲0.131
1M	-	-	-	▲0.171
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.160
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

12月7日の予定(時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
8:50	マネタリーベースと日本銀行の取引(11月)	-	19:00	(欧)7-9月期域内総生産(GDP)確報値[前年比]
15:00	コール市場残高(11月)	-	22:30	(米)11月非農業部門雇用者数
	-	-	22:30	(米)11月失業率

経済指標及び予想値は株式会社フィスコ提供

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▲0.001%の▲0.070%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

週末3日積みである明日は、ビッドサイドはやや厚くなるものの、大きく取りあがる展開にはならず、レートは小幅上昇と予想する。

資金需給

[億円]

	日銀速報	日銀予想	当社需給予想
	12月6日	12月7日	12月10日
券	▲2,200	▲1,900	▲1,000
財政	+3,300	+700	▲17,000
過不足	+1,100	▲1,200	▲18,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国債買入	+7,600	-	-
共通担保(全店)	-	-	▲2,600
CP等買入	▲100	▲400	-
国債補完供給	+900	+1,200	+2,000
当座預金増減	+8,300	+1,600	▲20,600
当座預金残高	3,785,000	3,786,600	3,766,000
準備預金残高	3,328,200	主な需給要因	
積み終了先	3,328,000	-	-
超過準備	3,328,000	-	-
非準備先残高	456,800	-	-
準備預金進捗率	99.9%	-	-
平均	70.0%	-	-
乖離率	29.9%	-	-

12月6日のオペ結果 [円][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	按分
国債補完供給(12/6~12/7)	190,132	1,189	1,189	▲0.600	▲0.600	

マネタリーベース[億円]
12月5日時点 4,883,700

所要	[億円]
今積期の所要準備額	3,008,500
12月7日以降の残高	
積数	1,500
平均	200

国庫短期証券入札予定

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21日 3ヶ月
国債入札予定
12月11日 30年
12月13日 5年
12月18日 20年
12月26日 2年

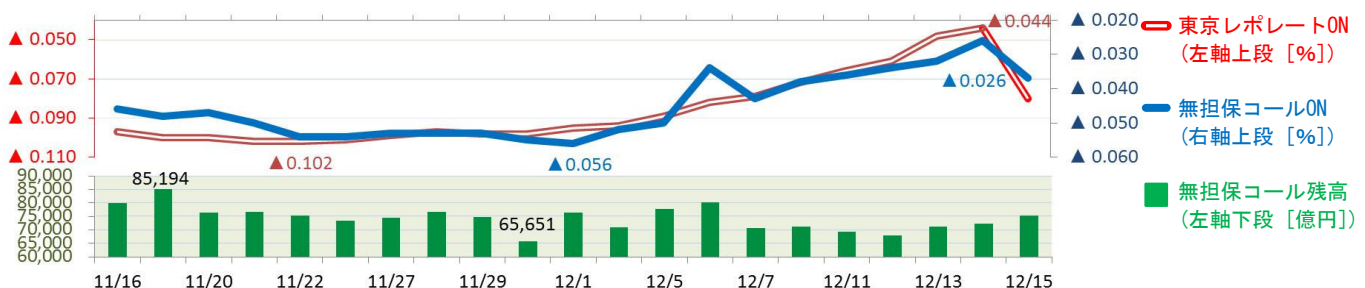
今月の国債買入オペ予定

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		12月3日	3
3年超5年以下	3,000~5,500 程度	4,000		12月5日	4
5年超10年以下	3,000~6,000 程度	4,500		12月5日	3
10年超25年以下	1,500~2,500 程度	2,000		12月5日	1
25年超	100~1,000 程度	500		10月17日	1
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		

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。