

### 短期市場の推移

	12月3日	12月4日	12月5日	12月6日
加重平均金利	▲0.069	▲0.069	▲0.069	▲0.070
東京レポレート(ON)	▲0.091	▲0.092	▲0.090	▲0.089
無コール残	66,414	72,531	76,574	82,221
ON	37,124	42,961	46,904	52,096
その他	29,290	29,570	29,670	30,125
有コール残	28,346	27,011	35,298	33,178

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10日の予定(時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
8:50	7-9月期GDP 改定値[前期比年率]		▲2.0%
			-
			-

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	▲0.067	▲0.088
T/N	-	-	▲0.015	▲0.093
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.053	▲0.017	▲0.041	▲0.115
2W	▲0.047	▲0.035	▲0.041	▲0.127
3W	-	-	-	▲0.176
1M	-	-	-	▲0.184
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.163
6M	-	-	-	▲0.159
1Y	-	-	-	▲0.161

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%~▲0.035%の水準で取引された。週末要因で地銀の調達意欲が若干強まったことで、同加重平均金利は前営業日対比+0.003%の▲0.067%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.086 ~ ▲0.086	-	▲0.086 ~ ▲0.035

### 翌営業日のマーケット

積み最終日に向けて地銀の調達が継続し、レートは小幅上昇を予想する。

### 資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	12月7日	12月10日	12月7日	12月10日	12月11日	12月11日
券	▲1,800	▲700	▲1,800	▲700	▲2,000	▲2,000
財政	+1,000	▲15,900	+1,000	▲15,900	+3,000	+3,000
過不足	▲800	▲16,600	▲800	▲16,600	+1,000	+1,000
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
共通担保(全店)			▲2,600	+3,100		
CP等買入	▲400	+2,000	▲200			
ETF買入				+400		
国債補完供給	+1,200	▲700	+700			
当座預金増減	+1,300	▲15,200	+1,300	▲15,200	+1,000	+1,000
当座預金残高	3,786,300	3,771,100	3,786,300	3,771,100	3,772,100	3,772,100
準備預金残高	3,351,800		3,351,800			
積み終了先	3,351,600		3,351,600			
超過準備	3,351,600		3,351,600			
非準備預金残高	434,500		434,500			
準備預金進捗率	99.9%		99.9%			
平均	80.0%		80.0%			
乖離率	19.9%		19.9%			

### 12月7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
国債補完供給(12/7~12/10)	114,017	643	643	▲0.600	▲0.600	
共通担保(全店)(12/10~12/25)	8,000	3,131	3,131			

マナタリーベース [億円]	所要 [億円]
12月6日時点 4,894,200	今積期の所要準備額 3,011,600
	12月10日以降の残り所要積数 1,000
	平均 200

### 国庫短期証券入札予定

12月14日	3ヶ月	第802回
12月19日	1年	
12月21日	3ヶ月	
1月8日	3ヶ月	
12月11日	30年	
12月13日	5年	
12月18日	20年	
12月26日	2年	

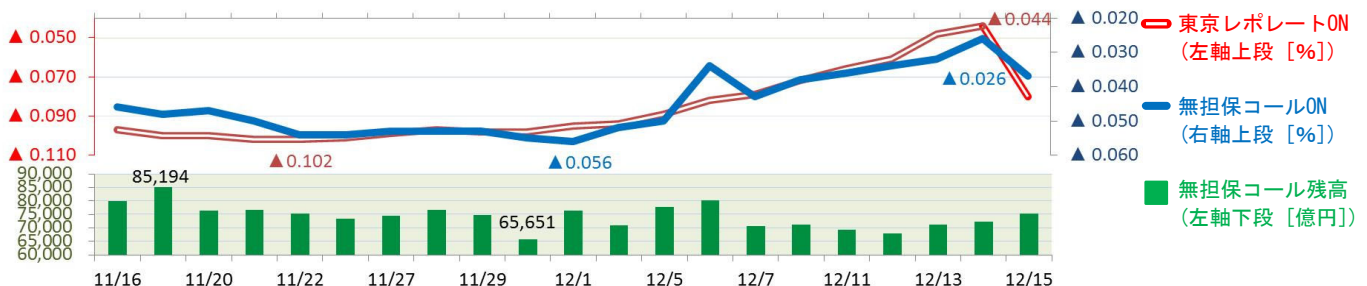
### 今月の国債買入オペ予定

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。