

短期市場の推移

	12月5日	12月6日	12月7日	12月10日
加重平均金利	▲0.069	▲0.070	▲0.067	▲0.068
東京レポレート(ON)	▲0.090	▲0.089	▲0.088	▲0.085
無コール残	76,574	82,221	78,525	84,804
ON	46,904	52,096	47,090	52,689
その他	29,670	30,125	31,435	32,115
有コール残	35,298	33,178	25,937	29,863

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	▲0.068	▲0.085
T/N	-	-	▲0.015	▲0.085
S/N	-	-	▲0.040	-
1W	-	-	▲0.020	▲0.124
2W	-	-	-	▲0.144
3W	-	-	-	▲0.250
1M	-	-	-	▲0.243
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.169
6M	-	-	-	▲0.160
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

12月12日の予定(時刻は日本時間)

日本			海外		
		予想			予想
8:50	11月国内企業物価指数 [前年比]	+2.4%	21:00	(米)MBA住宅ローン申請 指数[前週比]	-
8:50	10月機械受注[前月比]	+10.2%	22:30	(米)11月消費者物価コア 指数[前年比]	2.2%
10:00	営業毎旬報告 (12月10日現在)	-		-	

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%~▲0.035%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▲0.068%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.086 ~ ▲0.085	-	▲0.086 ~ ▲0.045

翌営業日のマーケット

積調整ニーズの高まりからやや強含むと予想する。

資金需給

	日銀速報	日銀予想	当社需給予想
	12月11日	12月12日	12月13日
券	▲1,400	▲2,000	▲3,000
財政	+2,300	▲8,500	+5,000
過不足	+900	▲10,500	+2,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国庫短期証券買入	▲200	+12,300	▲500
国債買入	▲200	▲500	▲100
CP等買入	▲200	▲500	▲100
社債等買入	▲200	▲500	▲100
ETF買入	▲200	▲500	▲100
国債補完供給	+500	▲3,600	+3,600
当座預金増減	+10,300	▲6,500	+2,000
当座預金残高	3,778,100	3,771,600	3,773,600
準備預金残高	3,347,600	3,347,500	3,347,500
積み終了先	3,347,500	3,347,500	3,347,500
超過準備	3,347,500	3,347,500	3,347,500
非準備先残高	430,500	430,500	430,500
準備預金進捗率	99.9%	99.9%	99.9%
平均	86.7%	86.7%	86.7%
乖離率	13.2%	13.2%	13.2%

[億円]

12月11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

国庫短期証券買入(12/12~)

1,000 5,955 1,001 0.002 0.002 98.2

米ドル資金供給(12/13~12/20)

3 3 2,700 2,700

CP等買入(12/14~)

2,000 5,620 1,980 ▲0.002 ▲0.002 42.3

国債補完供給(12/11~12/12)

184,451 3,427 3,427 ▲0.600 ▲0.600

マネタリーベース [億円]

12月10日時点 4,879,700

所要

今積期の所要準備額 3,011,600

12月12日以降の残り所要

積数 700

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

国債入札予定

12月13日 5年
12月18日 20年
12月26日 2年
1月8日 10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 10 17 25	12月10日	2
3年超5年以下	3,000~5,500 程度	4,000	5 10 14 19 27	12月10日	3
5年超10年以下	3,000~6,000 程度	4,500	5 14 25 27	12月5日	3
10年超25年以下	1,500~2,500 程度	2,000	月2回程度	12月5日	1
25年超	100~1,000 程度	500	1回	10月17日	1
物価連動債	250 程度	250			
変動利付債<偶数月>	1,000 程度	1,000			

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。

上田八木短資株式会社 登録金融機関 近畿財務局長(登金)第243号 加入協会 日本証券業協会