

### 短期市場の推移

[億円] [%]

	12月7日	12月10日	12月11日	12月12日
加重平均金利	▲0.067	▲0.068	▲0.068	▲0.066
東京レポレート(ON)	▲0.088	▲0.085	▲0.085	▲0.084
無コール残	78,525	84,804	91,167	90,291
ON	47,090	52,689	58,952	58,476
その他	31,435	32,115	32,215	31,815
有コール残	25,937	29,863	30,387	30,429

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14日の予定(時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
8:50	10-12月期日銀短観(大企業製造業DI)	-	22:30	(米)11月小売売上高	0.2%
8:50	短観(12月概要)	-	23:15	(米)11月鉱工業生産指数[前月比]	0.3%
8:50	短観(12月要旨)	-	23:45	(米)12月製造業PMI	-

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	▲0.062	▲0.083
T/N	▲0.045	▲0.015	▲0.033	▲0.151
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.025	0.001	▲0.019	▲0.169
2W	▲0.040	▲0.038	▲0.039	▲0.182
3W	-	-	-	▲0.300
1M	▲0.035	▲0.025	▲0.026	▲0.278
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.174
6M	-	-	-	▲0.163
1Y	-	-	-	▲0.164

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▲0.08%の出合から始まった。その後は主に▲0.086%~▲0.035%の水準で取引された。積最終日を前に積極的に調達をする先が増えたことで、同加重平均金利は前営業日対比+0.004%の▲0.062%となった。

都銀・信託		証券	地銀	
▲0.085 ~ ▲0.080		-	▲0.085 ~ ▲0.030	

### 翌営業日のマーケット

積最終日となるが、年金定時払いもあるため、本日よりは落ち着いた地合になると予想。

### 資金需給

[億円]

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	12月13日	12月14日	12月13日	12月14日	12月17日	12月18日
券	▲3,100	▲2,800	▲2,800	▲2,800	▲2,000	▲2,000
財政	+4,400	+53,100	+53,100	+53,100	+8,000	+8,000
過不足	+1,300	+50,300	+50,300	+50,300	+6,000	+6,000
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)					▲1,900	▲1,900
CP等買入	▲400	▲1,000	+2,000	+2,000		
ETF買入	+700					
国債補完供給	+600	▲600	+600	+600		
貸出増加支援		▲23,700	+17,400	+17,400		
当座預金増減	+1,600	+45,600	+45,600	+45,600	+4,100	+4,100
当座預金残高	3,773,300	3,818,900	3,818,900	3,818,900	3,823,000	3,823,000
準備預金残高	3,382,300	3,382,200	3,382,200	3,382,200	3,382,200	3,382,200
積み終了先	3,382,200	3,382,200	3,382,200	3,382,200	3,382,200	3,382,200
超過準備	3,382,100	3,382,100	3,382,100	3,382,100	3,382,100	3,382,100
非準備先残高	391,000	391,000	391,000	391,000	391,000	391,000
準備預金進捗率	99.9%	99.9%	99.9%	99.9%	99.9%	99.9%
平均	93.3%	93.3%	93.3%	93.3%	93.3%	93.3%
乖離率	6.6%	6.6%	6.6%	6.6%	6.6%	6.6%

12月13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(12/13~12/14)	149,027	538	538	▲0.600	▲0.600	

マナタリーベース [億円]  
12月12日時点 4,887,100

所要 [億円]	
今積期の所要準備額	3,011,600
12月14日以降の残り所要積数	500
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	第803回
12月21日	3ヶ月	
1月8日	3ヶ月	
12月18日	20年	
12月26日	2年	
1月8日	10年	
1月10日	30年	

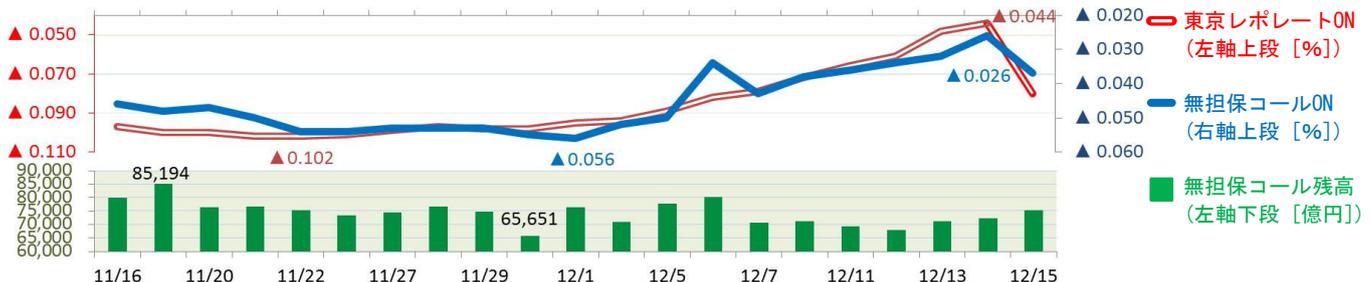
### 今月の国債買入オペ予定

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10日	2
5年超10年以下	3,000~6,000 程度	4,500	5 10 14 19 27	12月10日	3
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。