

短期市場の推移

	12月10日	12月11日	12月12日	12月13日
加重平均金利	▲0.068	▲0.068	▲0.066	▲0.062
東京レポレート(ON)	▲0.085	▲0.085	▲0.084	▲0.083
無コール残	84,804	91,167	90,291	85,894
ON	52,689	58,952	58,476	54,209
その他	32,115	32,215	31,815	31,685
有コール残	29,863	30,387	30,429	29,975

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17日の予定(時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
8:50	短観(12月業種別計数、「企業の物価見通し」の概要)	22:30	(米)12月ニューヨーク連銀製造業景気指数 20.2
8:50	短観(12月調査全容)	-	-
17:00	業態別の日銀当座預金残高(11月)	-	-

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	▲0.065	▲0.103
T/N	-	-	▲0.015	▲0.187
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	▲0.030	▲0.191
2W	-	-	▲0.040	▲0.310
3W	-	-	▲0.030	▲0.320
1M	▲0.020	0.000	▲0.011	▲0.301
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.177
6M	-	-	-	▲0.164
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▲0.086%の出合から始まった。その後は主に▲0.086%~▲0.04%の水準で取引された。今積み期における調達余力が限定的であったこととON物が来積み期にもかかる取引であることからビッドサイドが慎重な姿勢となり、同加重平均金利は前営業日対比▲0.003%の▲0.065%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.086 ~ ▲0.086	▲0.086 - ▲0.086	▲0.086 ~ ▲0.040

翌営業日のマーケット

新積み期に入るため、ビッドサイドは慎重な調達姿勢となると予想する。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	12月14日	12月17日	12月17日	12月18日	12月18日	12月18日
券	▲2,700	▲1,700	▲1,700	▲3,000	▲3,000	▲3,000
財政	+51,400	+10,400	+10,400	+5,000	+5,000	+5,000
過不足	+48,700	+8,700	+8,700	+2,000	+2,000	+2,000
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
国債買入	-	-	-	+7,000	-	-
共通担保(全店)	-	-	▲1,900	+1,900	-	-
CP等買入	▲1,000	+2,000	▲400	-	-	-
ETF買入	-	-	-	+1,700	-	-
国債補完供給	+600	▲700	+700	-	-	-
貸出増加支援	▲23,700	+17,400	-	-	-	-
当座預金増減	+43,300	+17,700	+17,700	+2,000	+2,000	+2,000
当座預金残高	3,816,600	3,834,300	3,834,300	3,836,300	3,836,300	3,836,300
準備預金残高	3,326,300	3,326,300	3,326,300	3,326,300	3,326,300	3,326,300
積み終了先	3,326,300	3,326,300	3,326,300	3,326,300	3,326,300	3,326,300
超過準備	3,326,100	3,326,100	3,326,100	3,326,100	3,326,100	3,326,100
非準備先残高	490,300	490,300	490,300	490,300	490,300	490,300
準備預金進捗率	100.0%	100.0%	100.0%	100.0%	100.0%	100.0%
平均	100.0%	100.0%	100.0%	100.0%	100.0%	100.0%
乖離率	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%

12月14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(12/17~)						
5~10年	4,300	9,383	4,307	▲0.013	▲0.011	13.3
10~25年	2,000	3,638	2,003	▲0.007	▲0.004	92.3
25年~	500	1,149	502	0.001	0.002	27.7
国債補完供給(12/14~12/17)						
84,911	663	663	▲0.600	▲0.600		
共通担保(全店)(12/17~1/8)						
8,000	1,945	1,945				

マナタリーベース	所要
12月13日時点 4,891,800	来積み期の所要準備額 3,124,000
	12月17日以降の残り所要積数 630,700
	平均 21,000

国庫短期証券入札予定

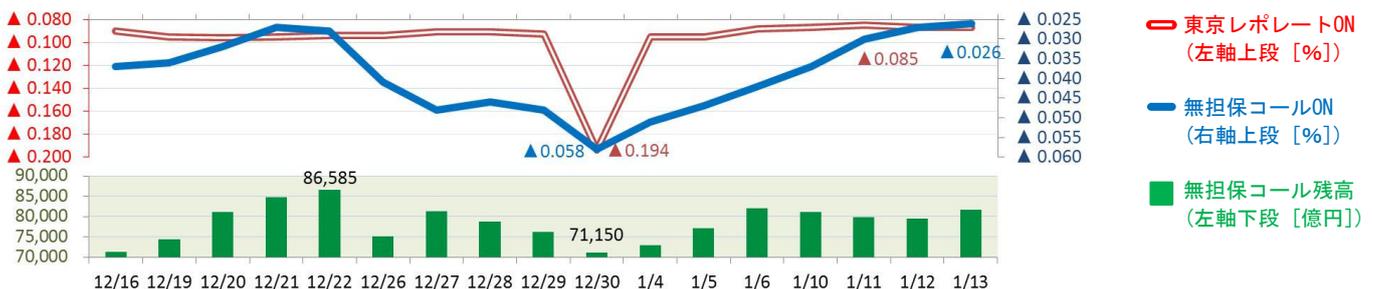
12月19日	1年	第803回
12月21日	3ヶ月	第804回
1月8日	3ヶ月	
1月9日	6ヶ月	
12月18日	20年	
12月26日	2年	
1月8日	10年	
1月10日	30年	

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	4,300	5 10 14 19 27	12月14日	2
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14日	2
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 ○2016年12月積み期 [12月16日~1月13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。