

短期市場の推移

	12月12日	12月13日	12月14日	12月17日
加重平均金利	▲0.066	▲0.062	▲0.065	▲0.067
東京レポレート(ON)	▲0.084	▲0.083	▲0.103	▲0.200
無コール残	90,291	85,894	74,800	75,564
ON	58,476	54,209	45,535	44,649
その他	31,815	31,685	29,265	30,915
有コール残	30,429	29,975	23,006	12,352

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19日の予定(時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想	
8:50	11月貿易収支	▲6,153億円	21:00	(米)MBA住宅ローン申請指数[前週比]	-
	日銀金融政策決定会合(20日まで)			(米)FOMCの結果	
				(米)パウエルFRB議長の見聞	

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	▲0.068	▲0.191
T/N	-	-	▲0.015	▲0.205
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.045	▲0.018	▲0.028	▲0.219
2W	-	-	-	▲0.362
3W	-	-	▲0.028	▲0.330
1M	-	-	-	▲0.313
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.181
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%~▲0.05%の水準で取引された。昨日に引き続きビッドサイドの慎重な動きにより軟調な地合となった。同加重平均金利は前営業日対比▲0.001%の▲0.068%だった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.086 ~ ▲0.086	-	▲0.086 ~ ▲0.050

翌営業日のマーケット

明日もビッドサイドの調達姿勢は変わらず、本日と同様の地合になると予想する。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	12月18日	12月19日	12月19日	12月20日	12月20日	12月21日
券	▲2,700	▲2,900	▲2,900	▲4,000	▲4,000	▲4,000
財政	▲1,400	▲9,300	▲9,300	+74,000	+74,000	+74,000
過不足	▲4,100	▲12,200	▲12,200	+70,000	+70,000	+70,000
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
国庫短期証券買入				+1,000		
国債買入		+8,600				
CP等買入	▲200		▲100			
社債等買入	▲300					
国債補完供給	+1,200	▲1,100	+1,100			
当座預金増減		+4,100	▲10,200			+70,000
当座預金残高	3,837,200		3,827,000			3,897,000
準備預金残高	3,321,700					
積み終了先	3,288,300					
超過準備	3,265,200					
非準備先残高	515,500					
準備預金進捗率		97.9%				
平均		9.7%				
乖離率		88.2%				

12月18日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	接分
国庫短期証券買入(12/19~)	1,000	2,791	1,000	0.160	0.160	
米ドル資金供給(12/20~1/10)			10	2.860	2.860	
社債等買入(12/25~)	750	3,050	751	0.042	0.081	75.8
国債補完供給(12/18~12/19)	95,719	996	996	▲0.600	▲0.600	
	10,000	100	100	▲0.600	▲0.600	

マナタリーベース	所要
12月17日時点 4,956,100	今積期の所要準備額 3,120,800
	12月19日以降の残り所要積数 65,900
	平均 2,400

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26日	2年	
1月8日	10年	
1月10日	30年	
1月16日	5年	

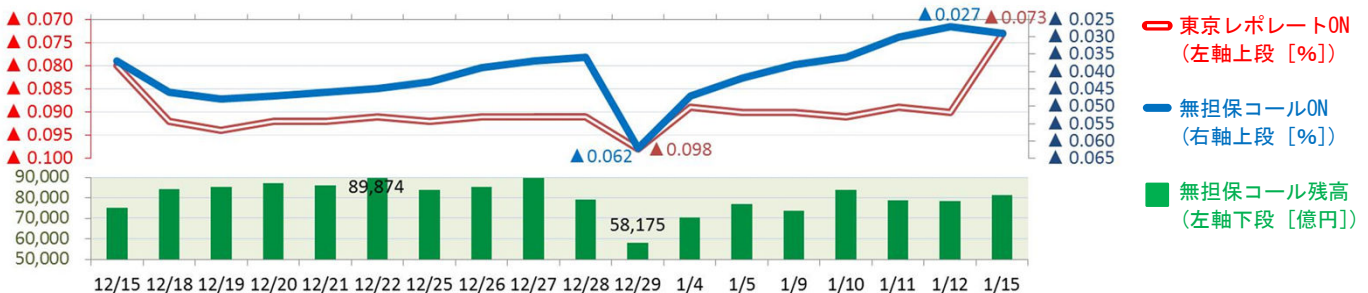
今月の国債買入オペ予定

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17日	1
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	12月17日	0

1年前の市場推移

○2017年12月積み期 [12月15日~1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。