

短期市場の推移

	12月13日	12月14日	12月17日	12月18日
加重平均金利	▲0.062	▲0.065	▲0.067	▲0.068
東京レポレート(ON)	▲0.083	▲0.103	▲0.200	▲0.191
無コール残	85,894	74,800	75,564	74,655
ON	54,209	45,535	44,649	41,360
その他	31,685	29,265	30,915	33,295
有コール残	29,975	23,006	12,352	11,224

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20日の予定(時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
日銀金融政策決定 会合結果公表		22:30	(米)新規失業保険 申請件数[前週分]
黒田日銀総裁会見		22:30	(米)12月フィラデルフィア 連銀製造業景況指数
-		0:00	(米)11月中古 住宅販売件数

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	▲0.070	▲0.174
T/N	-	-	▲0.015	▲0.201
S/N	-	-	▲0.086	-
1W	▲0.052	▲0.018	▲0.030	▲0.218
2W	-	-	▲0.020	▲0.346
3W	-	-	-	▲0.315
1M	-	-	-	▲0.292
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.180
6M	-	-	-	▲0.164
1Y	-	-	-	▲0.163

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。
同加重平均金利は前営業日対比▲0.002%の▲0.07%と、4営業日連続で低下した。

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

翌営業日のマーケット

本日と同様、軟調な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19日	12月20日	12月20日	12月21日	12月21日	12月22日
券	▲3,000	▲4,000	▲3,000	▲5,000	▲3,000	▲5,000
財政	▲9,700	+70,500	+70,500	▲4,000	▲9,000	▲4,000
過不足	▲12,700	+66,500	+66,500	▲9,000	▲9,000	▲9,000
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				+5,200		
CP等買入	▲100		▲200			
社債等買入			▲400			
被災地金融機関支援				▲100		+100
国債補完供給	+1,100	▲200	+200			
当座預金増減	▲10,900	+71,300	+71,300	▲9,000	▲9,000	▲9,000
当座預金残高	3,826,300	3,897,600	3,897,600	3,888,600	3,888,600	3,888,600
準備預金残高	3,330,500					
積み終了先	3,311,400					
超過準備	3,306,300					
非準備先残高	495,800					
準備預金進捗率	98.7%					
平均	12.9%					
乖離率	85.8%					

12月19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(12/20~)						
~1年	500	807	501	0.000	0.001	99.7
5~10年	4,300	12,562	4,306	▲0.018	▲0.016	97.2
物価連動	250	1,690	251	▲0.410	▲0.446	95.6
国債補完供給(12/19~12/20)						
73,639	145	145	▲0.600	▲0.600		
17,442	65	65	▲0.600	▲0.600		

マナタリーベース	所要
12月18日時点 4,962,900	今積期の所要準備額 3,120,800
	12月20日以降の残り所要積数 41,700
	平均 1,500

国庫短期証券入札予定

12月21日	3ヶ月	第804回
1月8日	3ヶ月	
1月9日	6ヶ月	
1月11日	3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19日	0
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19日	1
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19日	0
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。