

短期市場の推移

[億円] [%]

	12月17日	12月18日	12月19日	12月20日
加重平均金利	▲0.067	▲0.068	▲0.070	▲0.071
東京レポレート(ON)	▲0.200	▲0.191	▲0.174	▲0.179
無コール残	75,564	74,655	76,253	78,048
ON	44,649	41,360	42,418	42,463
その他	30,915	33,295	33,835	35,585
有コール残	12,352	11,224	11,451	11,190

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	▲0.071	▲0.156
T/N	-	-	▲0.015	▲0.155
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.070	▲0.035	▲0.055	▲0.250
2W	▲0.040	▲0.030	▲0.035	▲0.231
3W	▲0.017	▲0.010	▲0.017	▲0.209
1M	-	-	-	▲0.197
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.174
6M	-	-	-	▲0.163
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

12月25日の予定(時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
8:50	企業向けサービス価格指数(11月)	-	-	-
10:00	営業毎旬報告(12月20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。その後は主に▲0.086%～▲0.050%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▲0.071%となった。

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

週明けも変わらず、ビッドサイドが薄い軟調な地合が継続すると予想する。

資金需給

[億円]

	日銀速報		日銀予想	当社需給予想
	12月21日	12月25日	12月26日	12月26日
券	▲4,700	▲3,000	▲3,000	▲3,000
財政	+3,100	▲100	▲1,000	▲1,000
過不足	▲1,600	▲3,100	▲4,000	▲4,000
金融調節	エンド	スタート	スタート	エンド
共通担保(全店)	▲800	▲3,100	+5,500	▲3,100
CP等買入	▲800	▲800	▲800	▲800
社債等買入	▲100	▲100	+800	+800
ETF買入	▲100	+100	+2,500	+2,500
被災地金融機関支援	+100	▲200	+200	+200
国債補完供給	+100	▲200	+200	+200
当座預金増減	▲2,500	+1,900	▲4,000	▲4,000
当座預金残高	3,896,200	3,898,100	3,894,100	3,894,100
準備預金残高	3,371,300	主な需給要因		
積み終了先	3,370,900	国庫短期証券		
超過準備	3,367,500	発行・償還(3M)		
非準備預金残高	524,900	99.7%		
準備預金進捗率	99.7%	29.0%		
平均	29.0%	70.7%		
乖離率	70.7%			

12月21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	按分
国債補完供給(12/21~12/25)	54,592	183	183	▲0.600	▲0.600	
共通担保(全店)(12/25~1/15)	8,000	5,466	5,466			

マネタリーベース[億円]
12月20日時点 5,031,600

所要
今積期の所要準備額 3,120,800
12月25日以降の残り所要
積数 8,800
平均 400

国庫短期証券入札予定

1月8日	3ヶ月
1月9日	6ヶ月
1月11日	3ヶ月
1月17日	1年
12月26日	2年
1月8日	10年
1月10日	30年
1月16日	5年

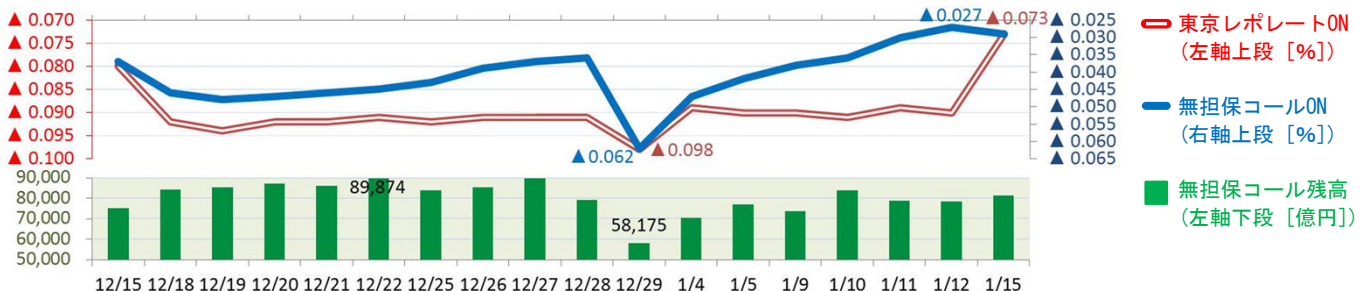
今月の国債買入オペ予定

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 10 17 25	12月17日	1
3年超5年以下	3,000~5,500 程度	4,000	5 10 14 19 27	12月19日	1
5年超10年以下	3,000~6,000 程度	4,300	5 14 25 27	12月14日	2
10年超25年以下	1,500~2,500 程度	2,000	月2回程度	12月19日	0
25年超	100~1,000 程度	500	1回	12月17日	0
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。