

短期市場の推移

	12月18日	12月19日	12月20日	12月21日
加重平均金利	▲0.068	▲0.070	▲0.071	▲0.071
東京レポレート(ON)	▲0.191	▲0.174	▲0.179	▲0.156
無コール残	74,655	76,253	78,048	76,152
ON	41,360	42,418	42,463	39,807
その他	33,295	33,835	35,585	36,345
有コール残	11,224	11,451	11,190	12,395

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26日の予定(時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
8:50 金融政策決定会合 議事要旨 (10月30・31日分)	-	21:00 (米)MBA住宅ローン申請指数[前週比]	-
14:00 基調的なインフレ率を捕捉するための指標	-	23:00 (米)10月S&P/コアロジックCS20都市住宅価格指数[前年比]	4.80%
- 【講演】黒田総裁(経団連審議委員会)	-	-	-

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	▲0.101
T/N	-	-	▲0.015	▲0.119
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	-	▲0.210
2W	-	-	-	▲0.187
3W	-	-	-	▲0.177
1M	-	-	▲0.017	▲0.173
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.170
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%~▲0.045%の水準で取引された。同加重平均金利は前営業日対比+0.001%の▲0.070%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.086 ~ ▲0.086	▲0.086 ~ ▲0.086	▲0.086 ~ ▲0.045

翌営業日のマーケット

引続き、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

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	12月25日	12月26日	12月25日	12月26日	12月27日	12月28日
券	▲3,200	▲3,600	▲3,600	▲3,600	▲3,000	▲3,000
財政	+1,100	+600	+600	+600	▲2,000	▲2,000
過不足	▲2,100	▲3,000	▲3,000	▲3,000	▲5,000	▲5,000
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				+10,500		
共通担保(全店)	▲3,100	+5,500				
CP等買入	▲800		▲500			
社債等買入	▲100	+800				
ETF買入		+2,500				
国債補完供給	+200	▲200	+200			
当座預金増減	+2,700	+7,200	+7,200		▲5,000	
当座預金残高	3,898,900	3,906,100	3,906,100		3,901,100	
準備預金残高	3,392,300					
積み終了先	3,391,900					
超過準備	3,391,900					
非準預先残高	506,600					
準備預金進捗率		99.7%				
平均		32.3%				
乖離率		67.5%				

12月25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(12/26~)						
1~3年	3,500	8,024	3,503	▲0.009	▲0.006	35.3
3~5年	4,000	10,237	4,003	▲0.022	▲0.019	66.6
10~25年	2,000	5,355	2,004	▲0.039	▲0.034	24.7
25年~	500	1,222	502	▲0.048	▲0.040	36.0
CP等買入(12/28~)						
2,000	6,927	1,967	▲0.001	0.003	45.2	
国債補完供給(12/25~12/26)						
72,669	163	163	▲0.600	▲0.600		

マナタリーベース	所要
12月21日時点 5,033,800	今積期の所要準備額 3,120,800
	12月26日以降の残り所要積数 8,400
	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年超5年以下	3,000~5,500 程度	4,000	3 10 17 25	12月25日	0
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25日	1
物価運動債	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。