



短期市場の推移

[億円] [%]

	12月4日	12月5日	12月8日	12月9日
加重平均金利	0.477	0.477	0.477	0.482
東京レボ レート(TN)	0.501	0.502	0.501	0.502
無コール残	82,044	74,563	74,473	76,719
ON	34,702	28,411	28,221	30,907
その他	47,342	46,152	46,252	45,812
有コール残	27,107	27,083	27,043	26,886

加重平均金利・コール残高は日銀、東京レボ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、無担保コール残高は無担保・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)			レボ市場
	最低	最高	平均	東京レボ レート
O/N	0.450	0.530	0.477	0.500
T/N	-	-	-	0.502
S/N	-	-	-	-
1W	0.482	0.610	0.514	0.497
2W	-	-	0.476	0.518
3W	-	-	-	0.561
1M	-	-	-	0.618
2M	-	-	-	-
3M	-	-	0.810	0.682
6M	-	-	-	0.723
1Y	-	-	-	0.781

無担保コール(速報)は日銀、東京レボレートは日本証券業協会公表

資金需給

[億円]

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	12月10日	12月11日	12月10日	12月11日	12月10日	12月11日
券	▲1,200	▲2,300	▲1,200	▲2,300	▲1,200	▲2,300
財政	▲22,400	▲6,900	▲22,400	▲6,900	▲22,400	▲6,900
過不足	▲23,600	▲9,200	▲23,600	▲9,200	▲23,600	▲11,000
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						
共通担保(全店)	▲8,000	+8,000				
社債等買入	▲200					
国債補完供給	+1,700	▲1,200	+1,200			
当座預金増減	▲23,300	▲1,600	▲23,300	▲1,600	▲23,300	▲11,000
当座預金残高	4,686,800	4,685,200	4,686,800	4,685,200	4,686,800	4,674,200
準備預金残高	4,320,000		4,320,000		4,320,000	
積み終了先	4,319,600		4,319,600		4,319,600	
超過準備	4,319,600		4,319,600		4,319,600	
非準備先残高	366,800		366,800		366,800	
準備預金進捗率	99.9%		99.9%		99.9%	
平均	83.3%		83.3%		83.3%	
乖離率	16.6%		16.6%		16.6%	

国庫短期証券入札予定

12月12日	3ヶ月(第1350回)
12月17日	1年(第1351回)
12月18日	3ヶ月
1月6日	3ヶ月

国債入札予定

12月11日	20年
12月25日	2年
1月6日	10年
1月8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	1000	1,000	3	12月3日	0
1年超3年以下	3000	3,000	3 10 17	12月10日	1
3年超5年以下	2800	2,800	3 17 24	12月3日	2
5年超10年以下	3050	3,050	10 17 24	12月10日	2
10年超25年以下	1150	1,150	3 17 24	12月3日	2
25年超	750	750	10 24	12月10日	1
物価連動債	500	500	24	11月27日	1
変動利付債	-	300	-	4月14日	-

12月11日の予定(時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-		(米) 貿易収支(9月)	
-		-	
-		-	

本日の市況

無担保コールON物は0.477%の出合から始まり、その後も同程度で推移した。ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.005%の0.477%となった。

都銀・信託	証券	地銀
- ~ -	0.477 ~ 0.477	0.477 ~ 0.477

翌営業日のマーケット

出合いの水準は本日対比横ばい圏を予想する。

[%][億円]※米ドル資金供給は百万\$

12月10日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
------	------	----	----	----	----	----

国債買入(12/11~)

1~3年	3,000	11,445	3,001	0.009	0.010	87.6
5~10年	3,050	4,913	3,053	▲0.008	▲0.005	45.4
25年~	750	1,508	751	0.000	0.011	54.5

国債補完供給(12/10~12/11)

1,205	1,205	0.250	0.250
0	0		

マネタリーベース [億円]

12月9日時点 5,932,000

所要

今積期の所要準備額	3,987,700
12月11日以降の残り所要	
積数	200
平均	0

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。

上田八木短資株式会社 登録金融機関 近畿財務局長(登金)第243号 加入協会 日本証券業協会