



## 短期市場の推移

[億円] [%]

	12月5日	12月8日	12月9日	12月10日
加重平均金利	0.477	0.477	0.482	0.477
東京レボ レート(TN)	0.502	0.501	0.502	0.502
無コール残	74,563	74,473	76,719	76,963
ON	28,411	28,221	30,907	30,291
その他	46,152	46,252	45,812	46,672
有コール残	27,083	27,043	26,886	27,797

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、無有コール残は無担保・有担保コール残高の重。

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	0.525	0.478	0.500
T/N	-	-	-	0.502
S/N	-	-	-	-
1W	0.475	0.530	0.486	0.497
2W	0.481	0.485	0.484	0.534
3W	-	-	-	0.572
1M	-	-	-	0.624
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	0.686
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11日	12月12日	12月12日	12月12日	12月15日	12月15日
券	▲2,300	▲1,500	▲1,500	▲1,000	▲1,000	▲1,000
財政	▲9,000	▲14,100	▲14,100	+74,000	+74,000	+74,000
過不足	▲11,300	▲15,600	▲15,600	+73,000	+73,000	+73,000
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		+6,400				
社債等買入			▲200			
貸出増加支援				▲54,000		+5,900
国債補完供給	+1,200	▲300	+300			
当座預金増減	▲4,000	▲15,500	▲15,500	+24,900	+24,900	+24,900
当座預金残高	4,682,800	4,667,300	4,667,300	4,692,200	4,692,200	4,692,200
準備預金残高	4,300,500					
積み終了先	4,300,500					
超過準備	4,300,300					
非準備先残高	382,300					
準備預金進捗率	100.0%					
平均	86.7%					
乖離率	13.3%					

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(第1352回)
1月6日	3ヶ月
国債入札予定	
12月25日	2年
1月6日	10年
1月8日	30年
1月14日	5年

今月の国債買入オペ予定

オペ種類	一回当たりオペ金額	直近オペ金額	オペ予定日	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12日の予定(時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
13:30	鉱工業生産(10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+0.001%の0.478%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11日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
国債補完供給(12/11~12/12)	447	447	0.250	0.249		
	0	0				

マネタリーベース [億円]

12月10日時点 5,909,700

所要

今積期の所要準備額 3,987,700

12月12日以降の残り所要

積数 0

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