



短期市場の推移

[億円] [%]

	12月9日	12月10日	12月11日	12月12日
加重平均金利	0.482	0.477	0.478	0.477
東京レポレート(TN)	0.502	0.502	0.502	0.503
無コール残	76,719	76,963	78,785	74,396
ON	30,907	30,291	31,213	27,274
その他	45,812	46,672	47,572	47,122
有コール残	26,886	27,797	27,229	27,088

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	0.450	0.530	0.477	0.499
T/N	-	-	-	0.502
S/N	-	-	-	-
1W	0.472	0.482	0.476	0.502
2W	-	-	-	0.570
3W	-	-	-	0.594
1M	-	-	-	0.649
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	0.696
6M	-	-	-	0.736
1Y	-	-	-	0.804

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

資金需給

[億円]

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	12月15日		12月16日		12月17日	
券	▲1,900		▲2,100		▲2,000	
財政	+59,900		+1,200		▲5,000	
過不足	+58,000		▲900		▲7,000	
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
国債補完供給	+900	▲1,000	+1,000			
貸出増加支援	▲46,300	+5,900				

国庫短期証券入札予定

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
1月8日	6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16日の予定 (時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
8:50	日銀短観 (12月調査全容)		(米)雇用統計(11月)	
17:00	業態別の 日銀当座預金残高(11月)		(米)小売売上高(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)は前営業日対比横ばいの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15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(12/15~12/16)

1,212 1,212 0.250 0.250
0 0

マネタリーベース [億円]

12月12日時点 5,896,600

所要

[億円]

来積期の所要準備額	4,132,600
12月16日以降の残り所要	
積数	4,132,600
平均	133,300

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