



短期市場の推移

[億円] [%]

	12月12日	12月15日	12月16日	12月17日
加重平均金利	0.477	0.477	0.482	0.478
東京レボ レート(TN)	0.503	0.502	0.502	0.501
無コール残	74,396	76,400	78,455	76,651
ON	27,274	28,948	31,323	29,649
その他	47,122	47,452	47,132	47,002
有コール残	27,088	28,318	28,850	28,786

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	0.530	0.477	0.497
T/N	-	-	-	0.499
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	-	0.586
2W	-	-	-	0.637
3W	-	-	-	0.658
1M	-	-	-	0.692
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	0.709
6M	-	-	-	0.749
1Y	-	-	-	0.824

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18日	12月19日	12月19日	12月22日	12月22日	12月22日
券	▲3,000	▲2,500	▲2,500	▲1,000	▲1,000	▲1,000
財政	+11,300	+6,200	+6,200	+41,000	+41,000	+41,000
過不足	+8,300	+3,700	+3,700	+40,000	+40,000	+40,000
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		+9,700				
社債等買入	▲100	▲2,100	▲2,100			
国債補完供給	+1,800	▲2,500	+2,500			
当座預金増減	+17,200	+4,100	+4,100	+40,000	+40,000	+40,000
当座預金残高	4,683,200	4,687,300	4,687,300	4,727,300	4,727,300	4,727,300
準備預金残高	4,292,400	主な需給要因				
積み終了先	4,249,400					
超過準備	4,192,800					
非準備先残高	390,800					
準備預金進捗率	97.9%	国庫短期証券発行償還 (3M・1Y) 国債償還(5年・10 年・20年) 利払い				
平均	9.7%					
乖離率	88.3%					

国庫短期証券入札予定

1月6日	3ヶ月
1月8日	6ヶ月
1月9日	3ヶ月
1月16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17日	0
3年超5年以下	2800	2,800	3 17 24	12月17日	1
5年超10年以下	3050	3,050	10 17 24	12月17日	1
10年超25年以下	1150	1,150	3 17 24	12月17日	1
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19日の予定(時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
	日銀金融政策決定会合 (2日目)			(欧) 経常収支(11月)	
8:30	CPI(11月)			-	
	-			-	

本日の市況

無担保コールON物は0.477%の出合から始まった。試し取り要因の剥落により、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.001%の0.477%となった。

都銀・信託		証券	地銀
- ~ -	0.477 ~ 0.477	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18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(12/18~12/19)	2,573	2,573	0.250	0.250		
	0	0				

マネタリーベース [億円]

12月17日時点 5,898,900

所要

今積期の所要準備額		4,132,600
12月19日以降の残り所要		
積数	85,300	
平均	3,000	

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