



短期市場の推移

	12月16日	12月17日	12月18日	12月19日
加重平均金利	0.482	0.478	0.477	0.477
東京レボ レート(TN)	0.502	0.501	0.499	0.687
無コール残	78,455	76,651	75,407	71,021
ON	31,323	29,649	29,425	27,673
その他	47,132	47,002	45,982	43,348
有コール残	28,850	28,786	28,648	28,710

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	0.700	0.780	0.727	0.743
T/N	-	-	-	0.740
S/N	0.710	0.720	0.715	-
1W	0.720	0.870	0.761	0.724
2W	0.726	0.740	0.728	0.711
3W	-	-	-	0.719
1M	-	-	0.830	0.721
2M	-	-	-	-
3M	0.830	0.850	0.840	0.734
6M	-	-	-	0.757
1Y	-	-	-	0.846

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22日		12月23日		12月24日	
券		▲2,300		▲2,800		▲2,000
財政		+50,700		▲5,200		▲5,000
過不足		+48,400		▲8,000		▲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
共通担保(全店)					▲8,000	
CP等買入				▲100		
国債補完供給	+1,700	▲6,600	+6,600			

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23日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-		(米) 7~9月のGDP (1次統計値)	
-		(米) 鉱工業生産 (11月)	
-		-	

本日の市況

無担保コールON物は0.727%の出合から始まり、その後その後も同程度で推移した。本日より日銀当座預金の超過準備に0.75%の付利が適用され、付利金利との裁定を意識したレートに収束し、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.250%の0.727%となった。

都銀・信託	証券	地銀
- ~ -	0.727 ~ 0.727	0.727 ~ 0.727

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22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(12/22~12/23)

7,103	7,103	0.450	0.449
0	0		

マネタリーベース [億円]

12月19日時点 5,924,700

所要

今積期の所要準備額	4,132,600
12月23日以降の残り所要	
積数	15,400
平均	600

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