



短期市場の推移

[億円] [%]

	12月18日	12月19日	12月22日	12月23日
加重平均金利	0.477	0.477	0.727	0.727
東京レボレート(TN)	0.499	0.687	0.740	0.738
無コール残	75,407	71,021	71,164	73,869
ON	29,425	27,673	29,897	29,562
その他	45,982	43,348	41,267	44,307
有コール残	28,648	28,710	30,497	27,851

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	0.700	0.775	0.727	0.737
T/N	-	-	-	0.735
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	-	0.711
2W	0.720	0.734	0.727	0.711
3W	-	-	-	0.719
1M	-	-	0.805	0.724
2M	-	-	-	-
3M	-	-	0.830	0.734
6M	-	-	-	0.760
1Y	-	-	-	0.858

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24日	12月25日	12月25日	12月26日	12月26日	12月26日
券	▲2,800	▲3,200	▲3,200	▲2,000	▲2,000	▲2,000
財政	▲5,000	▲21,000	▲21,000	▲5,000	▲5,000	▲5,000
過不足	▲7,800	▲17,800	▲17,800	▲3,000	▲3,000	▲3,000
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				+7,200		
共通担保(全店)	▲8,000	+8,000				
CP等買入	▲400					
社債等買入	▲500		▲100			
国債補完供給	+4,600	▲3,700	+3,700			
当座預金増減	▲7,800	+10,800	+10,800	+3,000	+3,000	+3,000
当座預金残高	4,711,100	4,739,700	4,739,700	4,742,700	4,742,700	4,742,700
準備預金残高	4,304,500	主な需給要因				
積み終了先	4,303,400					
超過準備	4,303,100					
非準備先残高	406,600					
準備預金進捗率	99.7%					
平均	29.0%					
乖離率	70.7%					

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	一回当たりオペ金額	直近オペ額	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17日	0
3年超5年以下	2800	2,800	3 17 24	12月24日	0
5年超10年以下	3050	3,050	10 17 24	12月24日	0
10年超25年以下	1150	1,150	3 17 24	12月24日	0
25年超	750	750	10 24	12月24日	0
物価連動債	500	500	24	12月24日	0
変動利付債	-	300	-	4月14日	-

12月25日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
植田日銀総裁の講演 (日本経済団体連合会審議会)		(米) 休場	
-		(欧) 休場	
-		-	

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。ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比横ばいの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24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(12/25~)						
3~5年	2,800	6,640	2,807	▲0.016	▲0.014	71.9
5~10年	3,050	5,677	3,052	▲0.014	▲0.011	100.0
10~25年	1,150	2,320	1,151	0.024	0.031	72.2
25年~	750	2,707	751	0.050	0.063	16.5
物価連動	500	1,521	500	▲0.050	▲0.096	91.2
国債補完供給(12/24~12/25)						
	3,931	3,931	0.450	0.450		
	0	0				

マネタリーベース [億円]

12月23日時点 5,962,500

所要

今積期の所要準備額	4,132,600
12月25日以降の残り所要	
積数	10,400
平均	500

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