



短期市場の推移

[億円] [%]				
	12月19日	12月22日	12月23日	12月24日
加重平均金利	0.477	0.727	0.727	0.727
東京レボレート(TN)	0.687	0.740	0.738	0.735
無コール残	71,021	71,164	73,869	73,416
ON	27,673	29,897	29,562	27,014
その他	43,348	41,267	44,307	46,402
有コール残	28,710	30,497	27,851	27,414

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	0.728	0.744
T/N	-	-	-	0.743
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	-	0.716
2W	0.720	0.731	0.724	0.716
3W	-	-	-	0.723
1M	-	-	-	0.727
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	0.735
6M	-	-	-	0.761
1Y	-	-	-	0.863

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25日		12月26日		12月29日	
券		▲3,200		▲2,400		▲1,000
財政		+21,100		+500		▲6,000
過不足		+17,900		▲1,900		▲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
国債買入		+7,200				
社債等買入	▲100					
国債補完供給	+3,700	▲3,300	+3,300			
当座預金増減		+25,400		+1,400		▲7,000
当座預金残高		4,736,500		4,737,900		4,730,900
準備預金残高		4,332,000	主な需給要因			
積み終了先		4,330,700				
超過準備		4,330,600				
非準備先残高		404,500				
準備預金進捗率		99.8%				
平均		32.3%				
乖離率		67.5%				

12月25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(12/25~12/26)

3,380	3,380	0.450	0.450
141	141	0.450	0.450

マネタリーベース [億円]

12月24日時点 5,957,400

所要

[億円]

今積期の所要準備額 4,132,600

12月26日以降の残り所要

積数 9,000

平均 400

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

1月6日	10年
1月8日	30年
1月14日	5年
1月20日	20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	-

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