



短期市場の推移

	12月2日	12月3日	12月4日	12月5日
加重平均金利	0.227	0.227	0.227	0.232
東京レボレート(TN)	0.240	0.240	0.240	0.240
無コール残	77,960	77,758	79,762	82,052
ON	30,859	30,207	31,371	33,961
その他	47,101	47,551	48,391	48,091
有コール残	39,031	40,005	39,489	39,218

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	0.200	0.228	0.227	0.245
T/N	-	-	-	0.244
S/N	-	-	-	-
1W	0.278	0.390	0.280	0.214
2W	0.300	0.310	0.303	0.220
3W	-	-	-	0.237
1M	-	-	-	0.262
2M	-	-	-	-
3M	-	-	0.450	0.346
6M	-	-	-	0.390
1Y	-	-	-	0.472

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

12月9日の予定 (時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
8:50	実質GDP2次速報 (7~9月)		-	
8:50	国際収支 (10月)		-	
	-		-	

本日の市況

無担保コールON物は0.227%の出合から始まり、その後は主に同水準を中心に取引された。試し取り要因は剥落したものの、ビッドサイドの資金調達意欲は引き続き底堅く、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.005%の0.227%となった。

	都銀・信託	証券	地銀
	- ~ -	0.227 ~ 0.227	0.226 ~ 0.227

翌営業日のマーケット

ビッドサイドの資金調達意欲は引き続き旺盛であるため、出合の水準は本日対比横ばい圏を予想する。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想
	12月6日	12月9日	12月9日	12月10日	12月10日
券	▲1,200	▲1,200	▲1,200	▲1,200	+0
財政	▲7,600	▲7,600	▲10,100	▲10,100	+2,000
過不足	▲8,800	▲8,800	▲11,300	▲11,300	+2,000
金融調節	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド
CP等買入	▲200		▲100		
社債等買入	▲200		▲200		
国債補完供給	+5,400	▲4,100	+4,100		
当座預金増減	▲7,900	▲7,900	▲7,500	▲7,500	+2,000
当座預金残高	5,290,300	5,290,300	5,282,800	5,282,800	5,284,800
準備預金残高	4,740,800	4,740,800	4,740,700	4,740,700	4,740,700
積み終了先	4,740,700	4,740,700	4,740,700	4,740,700	4,740,700
超過準備	4,740,700	4,740,700	(3M)	(3M)	(6M)
非準備先残高	549,500	549,500	549,500	549,500	549,500
準備預金進捗率	99.9%	99.9%	99.9%	99.9%	99.9%
平均	76.7%	76.7%	76.7%	76.7%	76.7%
乖離率	23.2%	23.2%	23.2%	23.2%	23.2%

12月6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(12/6~12/9)	4,216	4,216	▲0.050	▲0.050		
	58	58	▲0.050	▲0.050		

マネタリーベース [億円]
12月5日時点 6,550,100

所要	[億円]
今積期の所要準備額	3,921,500
12月9日以降の残り所要	
積数	200
平均	0

国庫短期証券入札予定

12月9日	6ヶ月(第1274回)
12月13日	3ヶ月(第1275回)
12月18日	1年
12月20日	3ヶ月
12月10日	5年
12月17日	20年
12月26日	2年
1月7日	10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	1500	1,500	4	12月4日	0
1年超3年以下	3250	3,250	4 9 13 20	12月4日	3
3年超5年以下	3250	3,250	4 13 20 25	12月4日	3
5年超10年以下	3750	3,750	9 13 20 25	11月28日	4
10年超25年以下	1500	1,500	4 13 20	12月4日	2
25年超	750	750	9 25	11月22日	2
物価連動債	600	600	25	11月28日	1
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