



短期市場の推移

	12月4日	12月5日	12月6日	12月9日
加重平均金利	0.227	0.232	0.227	0.227
東京レボレート(TN)	0.240	0.240	0.244	0.240
無コール残	79,762	82,052	79,987	80,505
ON	31,371	33,961	30,596	30,784
その他	48,391	48,091	49,391	49,721
有コール残	39,489	39,218	39,384	39,008

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	0.220	0.275	0.227	0.243
T/N	-	-	0.200	0.247
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	0.390	0.226
2W	-	-	-	0.237
3W	-	-	-	0.246
1M	-	-	-	0.254
2M	-	-	-	-
3M	0.500	0.520	0.510	0.348
6M	-	-	-	0.391
1Y	-	-	-	0.480

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11日の予定 (時刻は日本時間)

日本		予想		海外		予想	
	-				-		
	-				-		
	-				-		

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。ビット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)は前営業日対比横ばいの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

ビット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10日	12月11日	12月10日	12月11日	12月10日	12月11日
券		▲1,800		▲1,500		▲1,000
財政		▲3,900		▲25,900		▲6,000
過不足		▲5,700		▲27,400		▲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		+7,700				
共通担保(全店)			▲8,000	+8,000		
国債補完供給	+5,900	▲3,400	+3,400			
当座預金増減		+4,500		▲24,000		▲7,000
当座預金残高		5,278,400		5,254,400		5,247,400
準備預金残高		4,723,600	主な需給要因			
積み終了先		4,723,500	国債発行(5年)			
超過準備		4,723,500	源泉税揚げ			
非準備先残高		554,800				
準備預金進捗率		99.9%				
平均		83.3%				
乖離率		16.6%				

12月10日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
米ドル資金供給(12/12~12/19)	1	1	4,830	4,830		
国債補完供給(12/10~12/11)	3,413	3,413	▲0.050	▲0.050		
共通担保(全店)(12/11~12/25)	8,000	24,115	8,008		33.2	

マネタリーベース (億円)
 12月9日時点 6,528,200

所要	(億円)
今積期の所要準備額	3,921,500
12月11日以降の残り所要	
積数	100
平均	0

国庫短期証券入札予定

12月13日	3ヶ月(第1275回)
12月18日	1年
12月20日	3ヶ月
1月7日	3ヶ月
12月17日	20年
12月26日	2年
1月7日	10年
1月9日	30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9日	2
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	12月9日	3
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	12月9日	1
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