



短期市場の推移

	12月6日	12月9日	12月10日	12月11日
加重平均金利	0.227	0.227	0.227	0.227
東京レポレート(TN)	0.244	0.240	0.247	0.248
無コール残	79,987	80,505	81,308	79,613
ON	30,596	30,784	31,317	29,672
その他	49,391	49,721	49,991	49,941
有コール残	39,384	39,008	38,710	39,325

加重平均金利、コール残高は日銀、東京レポ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)			レポ市場
	最低	最高	平均	東京レポレート
O/N	0.219	0.275	0.227	0.237
T/N	-	-	-	0.243
S/N	-	-	-	-
1W	0.231	0.300	0.272	0.231
2W	-	-	-	0.238
3W	-	-	-	0.242
1M	-	-	-	0.249
2M	-	-	0.530	-
3M	-	-	0.500	0.350
6M	-	-	-	0.394
1Y	-	-	-	0.486

無担保コール(速報)は日銀、東京レポレートは日本証券業協会公表

12月13日の予定 (時刻は日本時間)

		日本	予想	海外	予想
8:50	12月調査の日銀短観			-	
		-		-	
		-		-	

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12日	12月13日	12月12日	12月13日	12月16日	12月16日
券		▲2,800		▲1,900		▲2,000
財政		+10,300		+70,700		▲5,000
過不足		+7,500		+68,800		▲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
社債等買入		▲200		▲100		
国債補充供給		+3,100		+4,300		+4,300
貸出増加支援				▲46,200		+33,800
当座預金増減		+6,100		+60,600		▲7,000
当座預金残高		5,255,700		5,316,300		5,309,300
準備預金残高		4,710,800	主な需給要因			
積み終了先		4,710,800	年金定時払い		国債発行償還(個人向)	
超過準備		4,710,800	流動性供給		(+)	
非準備先残高		544,900			国庫短期証券発行償還	
準備預金進捗率		100.0%			(3M)	
平均		90.0%				
乖離率		10.0%				

12月12日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
国債補充供給(12/12~12/13)	4,364	4,364	▲0.050	▲0.050		
	0	0				

マネタリーベース [億円]
 12月11日時点 6,507,300

所要	[億円]
今積期の所要準備額	3,921,500
12月13日以降の残り所要	
積数	0
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(第1276回)
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