



短期市場の推移

	12月11日	12月12日	12月13日	12月16日
加重平均金利	0.227	0.227	0.227	0.227
東京レポレート(TN)	0.248	0.243	0.247	0.243
無コール残	79,613	79,533	79,459	81,716
ON	29,672	29,462	29,398	30,875
その他	49,941	50,071	50,061	50,841
有コール残	39,325	39,149	39,162	40,120

[億円] [%]

12月18日の予定 (時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
	日銀金融政策決定会合 (1日目)		(米) FOMC (2日目) パウエルFRB議長の会見	
8:50	貿易収支 (11月)		(欧) 消費者物価 (11月)	
	-		-	

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	-	-	-	0.244
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	-	0.233
2W	-	-	-	0.233
3W	-	-	-	0.236
1M	-	-	-	0.239
2M	-	-	-	-
3M	-	-	0.500	0.348
6M	-	-	-	0.396
1Y	-	-	-	0.489

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。

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

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	12月17日	12月18日	12月17日	12月18日	12月19日	12月19日
券		▲2,700		▲2,700		▲2,000
財政		+2,500		▲15,600		▲1,000
過不足		▲200		▲18,300		▲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
社債等買入	▲700					
国債補充供給	+4,300	▲3,700	+3,700			
当座預金増減		▲300		▲14,600		▲3,000
当座預金残高		5,321,500		5,306,900		5,303,900
準備預金残高		4,795,300	主な需給要因			
積み終了先		4,699,900	国債発行(20年)			
超過準備		4,365,000				
非準備先残高		526,200				
準備預金進捗率		97.5%				
平均		6.5%				
乖離率		91.0%				

12月17日のオペ結果

[%][億円] ※米ドル資金供給は百万\$

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(12/19~12/27)						
	1	1	4.620	4.620		
社債等買入(12/20~)						
	250	1,014	250	1.362	1.780	57.1
国債補充供給(12/17~12/18)						
	3,862	3,862	▲0.050	▲0.050		
	0	0				

マネタリーベース [億円]
12月16日時点 6,585,500

所要	所要
今積期の所要準備額	4,063,800
12月18日以降の残り所要	
積数	101,900
平均	3,500

国庫短期証券入札予定

12月18日	1年(第1276回)
12月20日	3ヶ月(第1277回)
1月7日	3ヶ月
1月9日	6ヶ月
国債入札予定	
12月26日	2年
1月7日	10年
1月9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13日 1
3年超5年以下	3250	3,250	4 13 20 25		12月13日 2
5年超10年以下	3750	3,750	9 13 20 25		12月13日 2
10年超25年以下	1500	1,500	4 13 20		12月13日 1
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