



短期市場の推移

	12月13日	12月16日	12月17日	12月18日
加重平均金利	0.227	0.227	0.227	0.226
東京レポレート(TN)	0.247	0.243	0.244	0.245
無コール残	79,459	81,716	82,799	81,470
ON	29,398	30,875	32,538	32,609
その他	50,061	50,841	50,261	48,861
有コール残	39,162	40,120	39,525	39,007

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	0.228	0.227	0.239
T/N	-	-	-	0.251
S/N	-	-	-	-
1W	0.231	0.390	0.288	0.232
2W	-	-	-	0.231
3W	0.300	0.330	0.311	0.235
1M	-	-	0.310	0.239
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	0.348
6M	-	-	-	0.397
1Y	-	-	-	0.489

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20日の予定 (時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
8:30	全国消費者物価(11月)		(米)	個人消費支出(11月)	
	-		(米)	ミシガン大消費者信頼感(確報)	
	-		(欧)	消費者信頼感(12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。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+0.001%の0.227%となった。また、日銀は本日の金融政策決定会合で、政策金利とする無担保コール翌日物レートを0.25%程度で据え置くと決めた。

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19日	12月20日	12月20日	12月23日	12月23日	12月23日
券						
財政						
過不足						
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
CP等買入						
社債等買入						
国債補完供給	+4,000	▲4,300	+4,300			
当座預金増減	+1,200	+49,700				
当座預金残高	5,302,300	5,352,000				
準備預金残高	4,796,100					
積み終了先	4,784,800					
超過準備	4,779,700					
非準備預金先高	506,200					
準備預金進捗率	99.1%					
平均乖離率	12.9%					
	86.2%					

12月19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(12/19~12/20)						
	4,462	4,462	▲0.050	▲0.050		
	0	0				

マネタリーベース (億円)
 12月18日時点 6,570,400

所要		所要
今積期の所要準備額	4,063,800	
12月20日以降の残り所要		
積数	37,700	
平均	1,400	

国庫短期証券入札予定

12月20日	3ヶ月(第1277回)
1月7日	3ヶ月
1月9日	6ヶ月
1月10日	3ヶ月
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		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