



短期市場の推移

	12月17日	12月18日	12月19日	12月20日
加重平均金利	0.227	0.226	0.227	0.227
東京レボレート(TN)	0.244	0.245	0.251	0.242
無コール残	82,799	81,470	80,958	77,261
ON	32,538	32,609	33,307	33,750
その他	50,261	48,861	47,651	43,511
有コール残	39,525	39,007	38,652	41,352

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	0.219	0.228	0.227	0.235
T/N	-	-	-	0.239
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	-	0.221
2W	-	-	0.231	0.218
3W	-	-	-	0.224
1M	-	-	-	0.229
2M	-	-	-	-
3M	0.500	0.550	0.533	0.328
6M	-	-	-	0.396
1Y	-	-	-	0.492

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24日の予定 (時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
8:50	金融政策決定会合議事要旨 (10月30~31日開催分)			
14:00	基調的なインフレ率を捕捉するための指標 (11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23日	12月24日	12月24日	12月25日	12月25日
券	▲2,400	▲2,900	▲2,900	▲3,000	▲3,000
財政	▲11,900	▲6,200	▲6,200	▲1,000	+1,000
過不足	▲14,300	▲9,100	▲9,100	▲2,000	▲2,000
金融調節	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド
国債買入		+11,400			
共通担保(全店)					▲8,000
CP等買入	▲300	▲100	▲100		
国債補充供給	+11,600	▲10,200	+10,200		
当座預金増減	▲1,800	+1,000	+1,000	▲10,000	▲10,000
当座預金残高	5,335,100	5,336,100	5,336,100	5,326,100	5,326,100
準備預金残高	4,830,700				
積み終了先	4,828,600				
超過準備	4,828,600				
非準備先残高	504,400				
準備預金進捗率	99.6%				
平均	25.8%				
乖離率	73.8%				

12月23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(12/23~12/24)	10,250	10,250	▲0.050	▲0.050		
	216	216	▲0.050	▲0.050		

マネタリーベース 【億円】
12月20日時点 6,611,900

所要	【億円】
今積期の所要準備額	4,063,800
12月24日以降の残り所要	
積数	15,800
平均	700

国庫短期証券入札予定

1月7日	3ヶ月
1月9日	6ヶ月
1月10日	3ヶ月
1月16日	1年
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20日	0
3年超5年以下	3250	3,250	4 13 20 25	12月20日	1
5年超10年以下	3750	3,750	9 13 20 25	12月20日	1
10年超25年以下	1500	1,500	4 13 20	12月20日	0
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