



短期市場の推移

	12月23日	12月24日	12月25日	12月26日
加重平均金利	0.227	0.227	0.227	0.227
東京レポレート(TN)	0.239	0.238	0.239	0.238
無コール残	74,736	76,242	75,096	74,102
ON	31,370	29,756	29,880	28,686
その他	43,366	46,486	45,216	45,416
有コール残	40,233	40,453	39,925	39,334

12月30日の予定 (時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
19:00	12月の外国為替平衡操作の実施状況		-	
	-		-	
	-		-	

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	0.221	0.228	0.227	0.241
T/N	-	-	0.410	0.239
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	-	0.223
2W	-	-	-	0.218
3W	-	-	-	0.218
1M	-	-	-	0.230
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	0.324
6M	-	-	-	0.396
1Y	-	-	-	0.492

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

12月末越えの調達を控えるビットサイドの動きが想定され、出合いの水準は本日対比若干の低下を予想する。

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

	[億円]		
	日銀速報	日銀予想	当社需給予想
	12月27日	12月30日	1月6日
券	▲2,000	▲200	+3,000
財政	▲11,700	▲10,700	+2,000
過不足	▲13,700	▲10,900	+5,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
CP等買入	▲700	▲1,600	+2,000
国債補充供給	+7,000	▲6,400	+6,400
当座預金増減	▲13,800	▲4,100	+5,000
当座預金残高	5,328,200	5,324,100	5,329,100
準備預金残高	4,829,900	主な需給要因	
積み終了先	4,829,400	国債発行償還(2年)	
超過準備	4,829,200		
非準備先残高	498,300		
準備預金進捗率	99.8%		
平均	45.2%		
乖離率	54.6%		

12月27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
国債補充供給(12/27~12/30)	6,579	6,579	▲0.050	▲0.050		
	0	0				

マネタリーベース [億円]
12月26日時点 6,627,600

所要		所要
今積期の所要準備額	4,063,800	
12月30日以降の残り所要		
積数	8,500	
平均	500	

国庫短期証券入札予定

1月7日	3ヶ月(第1278回)
1月9日	6ヶ月(第1279回)
1月10日	3ヶ月(第1280回)
1月16日	1年
国債入札予定	
1月7日	10年
1月9日	30年
1月14日	5年
1月16日	20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25日	0
5年超10年以下	3750	3,750	9 13 20 25	12月25日	0
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25日	0
物価連動債	600	600	25	12月25日	0
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