



短期市場の推移

	12月24日	12月25日	12月26日	12月27日
加重平均金利	0.227	0.227	0.227	0.227
東京レポレート(TN)	0.238	0.239	0.238	0.239
無コール残	76,242	75,096	74,102	76,029
ON	29,756	29,880	28,686	30,063
その他	46,486	45,216	45,416	45,966
有コール残	40,453	39,925	39,334	39,306

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、無有コール残は無担保・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	0.200	0.227	0.227	0.244
T/N	-	-	-	0.245
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	-	0.223
2W	-	-	-	0.223
3W	0.290	0.330	0.296	0.224
1M	-	-	0.370	0.235
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	0.325
6M	-	-	-	0.397
1Y	-	-	-	0.494

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

1月6日の予定 (時刻は日本時間)

時刻	日本	予想	海外	予想
	13:00	日銀当座預金増減要因と金融調節 (12月実績)		(米) 12月のサービス業PMI (確報)
	-		(欧) 12月のサービス業PMI (確報)	
	-		-	

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30日	1月6日	12月30日	1月6日	12月30日	1月6日
券	▲100		+2,700		+3,000	
財政	▲11,700		▲2,100		+1,000	
過不足	▲11,800		+600		+4,000	
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
CP等買入	▲1,600	+2,000				
国債補完供給	+6,400	▲8,000	+8,000			
共通担保オペ(全店)			▲30,000			
当座預金増減	▲13,000		▲21,400		+4,000	
当座預金残高	5,315,200		5,293,800		5,297,800	
準備預金残高	4,813,800		主な需給要因			
積み終了先	4,813,000		国債発行償還(2年)			
超過準備	4,812,900					
非準備先残高	501,400					
準備預金進捗率	99.9%					
平均	48.4%					
乖離率	51.5%					

12月30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(12/30~1/6)	8,229	8,229	▲0.050	▲0.050		
	0	0				

マネタリーベース [億円]
12月27日時点 6,615,800

所要	[億円]
今積期の所要準備額	4,063,800
1月6日以降の残り所要	
積数	2,300
平均	200

国債短期証券入札予定

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

来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	
			15	22	28	30			
1年以下	1500	1,500					12月4日	1	
1年超3年以下	3000	3,250	8	15	22	28		12月20日	4
3年超5年以下	3000	3,250	8	15	22	28		12月25日	4
5年超10年以下	3250	3,750	8	15	22	30		12月25日	4
10年超25年以下	1500	1,500	8	22	28			12月20日	3
25年超	750	750	15	30				12月25日	2
物価連動債	500	600	30					12月25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