



短期市場の推移

	12月17日	12月20日	12月21日	12月22日
加重平均金利	▲0.028	▲0.028	▲0.028	▲0.028
東京レポレート(TN)	▲0.087	▲0.087	▲0.087	▲0.086
無コール残	177,390	179,797	180,445	183,000
ON	101,947	102,874	102,062	102,817
その他	75,443	76,923	78,383	80,183
有コール残	18,625	17,743	17,801	17,593

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	▲0.060	0.001	▲0.027	▲0.082
T/N	▲0.045	▲0.010	▲0.022	▲0.074
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.025	▲0.020	▲0.023	▲0.084
2W	-	-	-	▲0.089
3W	-	-	-	▲0.092
1M	-	-	▲0.015	▲0.096
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.108
6M	-	-	-	▲0.119
1Y	-	-	-	▲0.130

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24日の予定 (時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
8:30	11月消費者物価QO指数 [前年比]	+0.4%	0:00	(米)11月新築住宅販売件数	76.7万戸

経済指標及び予想値は株式会社フィスコ提供

本日の市況

本日の無担保コールON物は▲0.030%の出から始まり、その後は主に▲0.050%~▲0.010%のレンジで推移した。ピッドサイドに大きな動向変化はなく、本日の同加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.001%の▲0.027%となった。本日オファーされた気候変動対応を支援するための資金供給は、貸付予定総額が20,483億円となった。

都銀・信託	証券	地銀
- ~ -	▲0.030 ~ ▲0.030	▲0.060 ~ ▲0.010

翌営業日のマーケット

一部運用ニーズの減退が見込まれるため、出合いの水準は本日対比上昇すると予想。

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27日	
債券	▲4,200		▲2,900		▲3,000	
財政	+3,200		+4,600		+0	
過不足	▲1,000		+1,700		▲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
CP等買入	▲500		▲800			
社債等買入			▲100	+800		
国債補完供給	+100	▲100	+100			
気候変動対応オペ				+20,500		
新型コロナ対応金融支援特別						▲107,800
当座預金増減	▲1,500		+22,200		▲110,800	
当座預金残高	5,382,500		5,404,700		5,293,900	
準備預金残高	4,756,800		主な需給要因			
積み終了先	4,756,400					
超過準備	4,756,300					
非準備先残高	625,700					
準備預金進捗率	99.9%					
平均	25.8%					
乖離率	74.1%					

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

国債補完供給(12/23~12/24)	108	108	▲0.350	▲0.350		
気候変動対応オペ(12/24~2023/1/30)	20,483	20,483				

マネタリーベース [億円]
12月22日時点 6,638,900

所要	所要準備額
今積期の所要準備額	3,769,300
12月24日以降の残り所要	
積数	3,300
平均	100

国債短期証券入札予定

1月5日	3ヶ月
1月6日	6ヶ月
1月7日	3ヶ月
1月14日	3ヶ月

国債入札予定

12月27日	2年
1月5日	10年
1月7日	30年
1月12日	5年

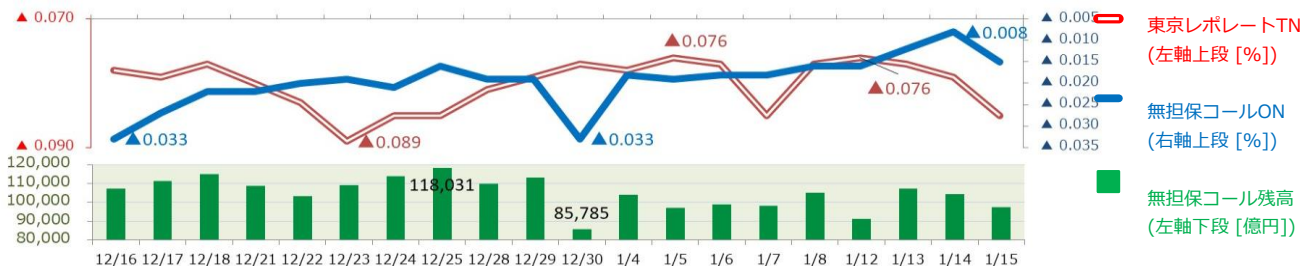
今月の国債買入オペ予定

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	月1回	12月8日	0
1年超3年以下	4500	4,500	3 8 15 21	12月21日	0
3年超5年以下	4500	4,500	3 15 21 24	12月21日	1
5年超10年以下	4250	4,250	8 15 21 24	12月21日	1
10年超25年以下	1500	1,500	3	12月3日	0
25年超	500	500	15	12月15日	0
物価連動債	600	600	月1回	11月29日	1
変動利付債<四半期>	300	300	四半期に1回	10月13日	0

1年前の市場推移

○2020年12積み期 [12月16日~1月15日]

※積み初日及び積み最終日が祝日・休日の場合は、前営業日のレート・残高を記載しています。



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