



短期市場の推移

	12月12日	12月13日	12月14日	12月15日
加重平均金利	▲0.077	▲0.075	▲0.068	▲0.064
東京レボレート(TN)	▲0.087	▲0.086	▲0.087	▲0.093
無コール残	136,881	138,718	145,004	135,534
ON	69,339	71,056	77,942	69,762
その他	67,542	67,662	67,062	65,772
有コール残	33,039	33,207	32,135	31,686

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)			レボ市場
	最低	最高	平均	東京レボレート
O/N	▲0.087	0.001	▲0.072	▲0.086
T/N	-	-	-	▲0.089
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	▲0.068	▲0.100
2W	▲0.075	▲0.033	▲0.071	▲0.158
3W	-	-	-	▲0.154
1M	-	-	0.140	▲0.149
2M	-	-	-	-
3M	-	-	0.000	▲0.140
6M	-	-	-	▲0.130
1Y	-	-	-	▲0.126

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19日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
日銀金融政策決定会合 (20日まで)			
-		-	
-		-	

本日の市況

本日の無担保コールON物は▲0.070%の出会いから始まり、その後は主に▲0.080%~▲0.068%の水準で取引された。12月積み期初日の本日は、ビッドサイドが様子見のため消極的な動きとなり、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.008%の▲0.072%となった。

都銀・信託	証券	地銀
- ~ -	▲0.080 ~ ▲0.078	▲0.075 ~ ▲0.065

翌営業日のマーケット

様子見をしていた先が調達を積極化させる可能性があり、出会い水準は本日対比横ばいかやや上昇を予想する。

資金需給

	日銀速報	日銀予想	当社需給予想
	12月16日	12月19日	12月20日
券	▲1,400	▲1,900	▲4,000
財政	+20,200	▲1,300	+84,000
過不足	+18,800	▲3,200	+80,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国債買入	+3,000	+1,400	▲1,500
共通担保(全店)			
CP等買入	▲800	▲100	
社債等買入	▲100	▲100	
国債補充供給	+13,400	+17,900	
当座預金増減	+16,400	+15,900	+78,500
当座預金残高	4,890,600	4,906,500	4,985,000
準備預金残高	4,284,000	主な需給要因	
積み終了先	4,255,800	国債短期証券発行・償還(3M)	
超過準備	2,998,200	国債大量償還・利払い	
非準備先残高	606,600	国債短期証券発行・償還(1Y)	
準備預金進捗率	98.8%		
平均	9.7%		
乖離率	89.1%		

12月16日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
国債買入(固定利回り方式)(12/19~)						
5~10年	1,425	1,425				
5~10年	0	0				
5~10年	0	0				
国債補充供給(12/16~12/19)						
	17,750	17,750	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マナタリーベース 12月15日時点 6,149,700

所要	所要
今積期の所要準備額	3,904,800
12月19日以降の残り所要	
積数	47,400
平均	1,700

国庫短期証券入札予定

12月19日	1年(第1128回)
1月5日	3ヶ月
1月6日	6ヶ月
1月10日	3ヶ月
12月27日	2年
1月5日	10年
1月11日	30年
1月13日	5年

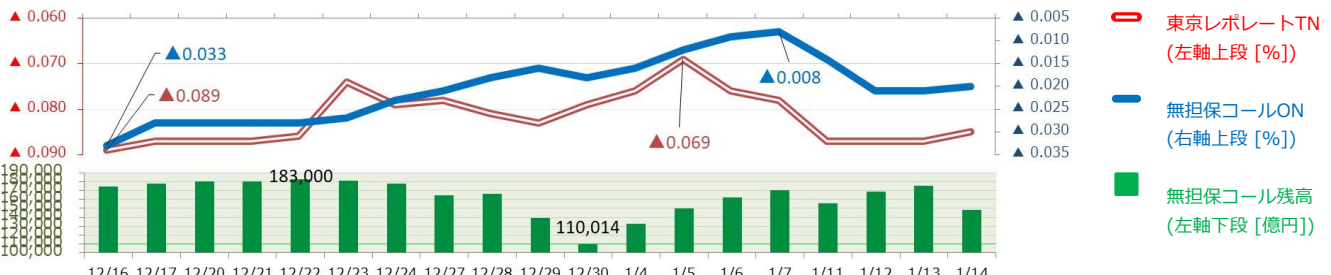
今月の国債買入オペ予定

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2日	0
1年超3年以下	4750	4,750	2 7 14 19	12月14日	1
3年超5年以下	4750	4,750	2 14 19 26	12月14日	2
5年超10年以下	5500	5,500	7 14 19 26	12月14日	2
10年超25年以下	2500	2,500	7 19 26	12月7日	2
25年超	1000	1,000	2 14 26	12月14日	1
物価連動債	600	600	月1回	11月14日	1
変動利付債<四半期>	300	300	四半期に1回	10月17日	-

1年前の市場推移

○2021年12月積み期 [12月16日~1月14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。投資については最終決定は、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