



短期市場の推移

	12月8日	12月9日	12月12日	12月13日
加重平均金利	▲0.077	▲0.077	▲0.077	▲0.075
東京レボレート(TN)	▲0.101	▲0.099	▲0.087	▲0.086
無コール残	138,054	136,932	136,881	138,718
ON	68,662	68,890	69,339	71,056
その他	69,392	68,042	67,542	67,662
有コール残	30,118	30,357	33,039	33,207

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	▲0.085	0.001	▲0.068	▲0.086
T/N	-	-	-	▲0.087
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	▲0.074	▲0.100
2W	▲0.075	▲0.003	▲0.069	▲0.109
3W	-	-	-	▲0.151
1M	-	-	-	▲0.149
2M	-	-	-	-
3M	-	-	0.001	▲0.137
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15日の予定 (時刻は日本時間)

日本		予想	海外	予想
8:50	11月貿易収支	-13800億円	4:00	(米)12月連邦公開市場委員会(FOMC)政策金利 4.50%
-	-	-	22:15	(欧)12月欧中銀(ECB)政策金利 2.50%
-	-	-	22:30	(米)12月ニューヨーク連銀製造業景気指数 -0.5

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▲0.070%の出会いから始まり、その後は主に▲0.070%~▲0.060%の水準で取引された。積み期最終日が近づくなかビッドサイドの調達ニーズは強く、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.007%の▲0.068%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.070 ~ ▲0.068	▲0.069 ~ ▲0.069	▲0.070 ~ ▲0.060

翌営業日のマーケット

積み期最終日となる明日も資金調達ニーズが強く、出会いの水準は上昇を予想する。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	12月14日	12月15日	12月14日	12月15日	12月16日	12月17日
券	▲2,400	▲3,000	▲2,400	▲3,000	▲4,000	▲4,000
財政	+3,300	+73,900	+3,300	+73,900	+18,000	+18,000
過不足	+900	+70,900	+900	+70,900	+14,000	+14,000
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
国庫短期証券買入		+1,000				
国債買入		+100		+16,200		
CP等買入	▲200		▲800			
社債等買入	▲100					
E T F 買入				+700		
国債補完供給	+13,300	▲11,100	+13,300	+11,100		
貸出増加支援	▲14,300	+36,700	▲14,300	+36,700		
当座預金増減		+26,300		+98,100		+14,000
当座預金残高		4,788,400		4,886,500		4,900,500
準備預金残高		4,235,100				主な需給要因
積み終了先		4,235,100		年金定時払い、個人国債発行(20年)、		
超過準備		4,234,800		債発行・償還		国庫短期証券償還(6M)
非準備先残高		553,300				
準備預金進捗率		100.0%				
平均乖離率		96.7%				
		3.3%				

12月14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)(12/15~)						
5~10年	238	238				
5~10年	0	0				
5~10年	0	0				
国債買入(12/15~)						
1~3年	4,750	8,653	4,754	▲0.003	▲0.001	28.5
3~5年	4,750	8,815	4,757	▲0.003	▲0.002	71.1
5~10年	5,500	19,686	5,511	▲0.002	▲0.001	15.8
25年~	1,000	2,553	1,005	▲0.015	▲0.014	79.3
国債補完供給(12/14~12/15)						
	11,034	11,034	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マナタリベース	所要
12月13日時点	6,032,200
今積期の所要準備額	3,771,000
12月15日以降の残り所要	
積数	0
平均	0

国庫短期証券入札予定

12月16日	3ヶ月(第1127回)
12月19日	1年(第1128回)
1月5日	3ヶ月
1月6日	6ヶ月
国債入札予定	
12月15日	20年
12月27日	2年
1月5日	10年
1月11日	30年

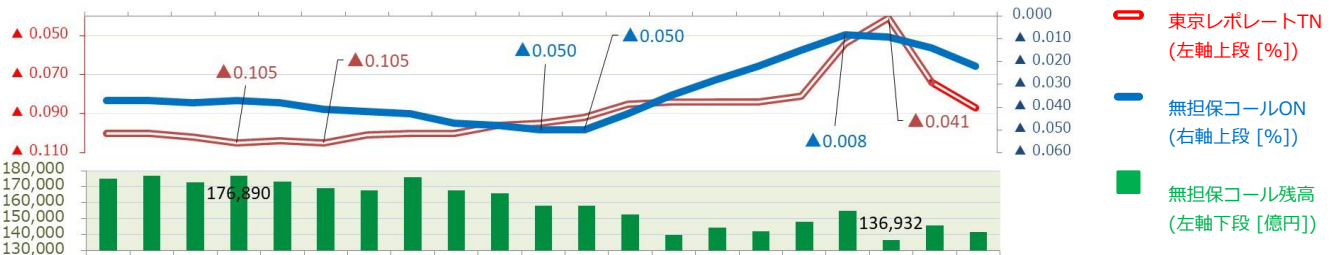
今月の国債買入オペ予定

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11月積み期 [11月16日~12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