



短期市場の推移

	12月9日	12月12日	12月13日	12月14日
加重平均金利	▲0.077	▲0.077	▲0.075	▲0.068
東京レポレート(TN)	▲0.099	▲0.087	▲0.086	▲0.087
無コール残	136,932	136,881	138,718	145,004
ON	68,890	69,339	71,056	77,942
その他	68,042	67,542	67,662	67,062
有コール残	30,357	33,039	33,207	32,135

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	▲0.080	0.001	▲0.064	▲0.086
T/N	-	-	-	▲0.093
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	▲0.075	▲0.099
2W	▲0.076	▲0.035	▲0.070	▲0.109
3W	-	-	-	▲0.153
1M	-	-	-	▲0.148
2M	-	-	-	-
3M	-	-	0.010	▲0.139
6M	-	-	-	▲0.130
1Y	-	-	-	▲0.126

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16日の予定 (時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
11月の業態別の日銀当座預金残高			欧	11月の消費者物価(確報)	
	-			-	
	-			-	

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▲0.060%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。本日は積み最終日であったことから、着地に向けた取り調整の動きがあり、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.004の▲0.064%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.070 ~ ▲0.065	▲0.060 ~ ▲0.060	▲0.070 ~ ▲0.060

翌営業日のマーケット

積み初日となる明日は、ビットサイドが慎重な動きをとることも想定され、出合の水準は本日対比で低下を予想する。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	12月15日		12月16日		12月19日	
券	▲3,000		▲1,400		▲2,000	
財政	+75,000		+20,800		▲3,000	
過不足	+72,000		+19,400		▲5,000	
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
国債買入	+16,200		+3,000			
CP等買入	▲800		▲800			
社債等買入	▲100		▲100			
E T F買入	+700					
国債補充供給	+11,100	▲13,400	+13,400			
当座預金増減	+85,800		+34,900		▲5,000	
当座預金残高	4,874,200		4,909,100		4,904,100	
準備預金残高	4,307,200		4,307,200		4,307,200	
積み終了先	4,307,200		4,307,200		4,307,200	
超過準備	4,307,200		4,307,200		4,307,200	
非準備先残高	567,000		567,000		567,000	
準備預金進捗率	100.0%		100.0%		100.0%	
平均	100.0%		100.0%		100.0%	
乖離率	0.0%		0.0%		0.0%	

12月15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)(12/16~)					
5~10年	2,967	2,967			
5~10年	0	0			
5~10年	0	0			
国債補充供給(12/15~12/16)	13,388	13,388	▲0.350	▲0.350	
	0	0			
社債等買入(12/20~)	1,000	1,580	1,000	0.202	0.223 95.7

マネタリーベース

12月14日時点	所要
6,060,900	来積期の所要準備額 3,904,800
	12月16日以降の残り所要 3,904,800
	積数 3,904,800
	平均 126,000

国債短期証券入札予定

12月16日	3ヶ月
12月19日	1年
1月5日	3ヶ月
1月6日	6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

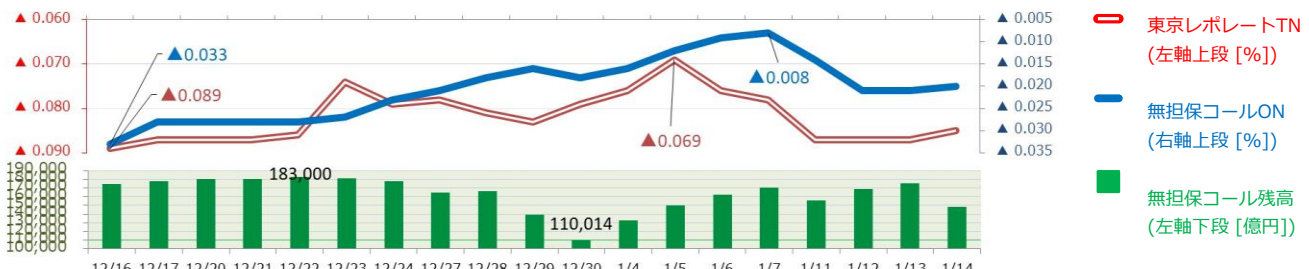
今日の国債買入オペ予定

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