



短期市場の推移

[億円] [%]

	12月14日	12月15日	12月16日	12月19日
加重平均金利	▲0.068	▲0.064	▲0.072	▲0.071
東京レボレート(TN)	▲0.087	▲0.093	▲0.089	▲0.091
無コール残	145,004	135,534	132,054	127,851
ON	77,942	69,762	68,632	63,049
その他	67,062	65,772	63,422	64,802
有コール残	32,135	31,686	31,308	30,357

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

12月21日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-		0:00 (米)11月中古住宅販売件数	
-			
-			

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▲0.065%の出会いから始まり、その後は主に▲0.072%～▲0.065%の水準で取引された。ビッドサイドの調達意欲は底堅く推移し一部取りあがる動きも見られたため、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.003%の▲0.068%となった。また本日開催された金融政策決定会合では、長短金利操作の運用の一部が見直され、長期金利の変動幅が従来の±0.25%程度から±0.50%程度までに拡大された。

	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	▲0.068	▲0.087
T/N	-	-	-	▲0.090
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.073	▲0.040	▲0.060	▲0.099
2W	-	-	-	▲0.163
3W	-	-	-	▲0.158
1M	-	-	-	▲0.154
2M	-	-	-	-
3M	-	-	0.028	▲0.138
6M	-	-	-	▲0.130
1Y	-	-	-	▲0.120

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

都銀・信託	証券	地銀
▲0.085 ~ ▲0.085	▲0.080 ~ ▲0.070	▲0.080 ~ ▲0.065

翌営業日のマーケット

ビッドサイドの調達意欲は引き続き旺盛とみられるため、本日対比横ばいもしくは、やや上昇を想定。

資金需給

[億円]

	日銀速報	日銀予想	当社需給予想
	12月20日	12月21日	12月22日
券	▲2,600	▲2,400	▲5,000
財政	+79,900	▲4,700	▲2,000
過不足	+77,300	▲7,100	▲7,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国債買入	+30,500	+19,200	
共通担保(全店)	▲1,500	+4,700	
CP等買入	▲400	▲200	
社債等買入	▲200	+1,000	
国債補完供給	+20,000	▲26,700	+26,700
当座預金増減	+104,700	+38,600	▲7,000
当座預金残高	4,993,300	5,031,900	5,024,900
準備預金残高	4,380,000		
積み終了先	4,374,700		
超過準備	4,373,200		
非準備先残高	613,300		
準備預金進捗率	99.4%		
平均	16.1%		
乖離率	83.2%		

12月20日のオペ結果

[%][億円]※米ドル資金供給は百万\$

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)(12/21~)

5~10年	2,947	2,947
5~10年	0	0
5~10年	0	0
5~10年	0	0
5~10年	0	0
5~10年	0	0
1~3年	0	0
3~5年	10,189	10,189
10~25年	0	0

米ドル資金供給(12/22~12/29)

0	0	4,580	4,580
---	---	-------	-------

国債補完供給(12/20~12/21)

26,249	26,249	▲0.350	▲0.350
344	344	▲0.350	▲0.350

国債買入(12/21~)

1~3年	1,000	2,235	1,001	0.020	0.022	12.3
3~5年	1,000	2,804	1,002	0.029	0.031	39.5
5~10年	3,000	4,375	3,001	0.000	0.077	36.6
10~25年	1,000	1,569	1,002	0.041	0.059	25.0

マネタリーベース [億円]

12月19日時点 6,167,400

所要

今積期の所要準備額 3,904,800

12月21日以降の残り所要

積数 25,100

平均 1,000

国庫短期証券入札予定

1月5日	3ヶ月
1月6日	6ヶ月
1月10日	3ヶ月
1月13日	3ヶ月

国債入札予定

12月27日	2年
1月5日	10年
1月11日	30年
1月13日	5年

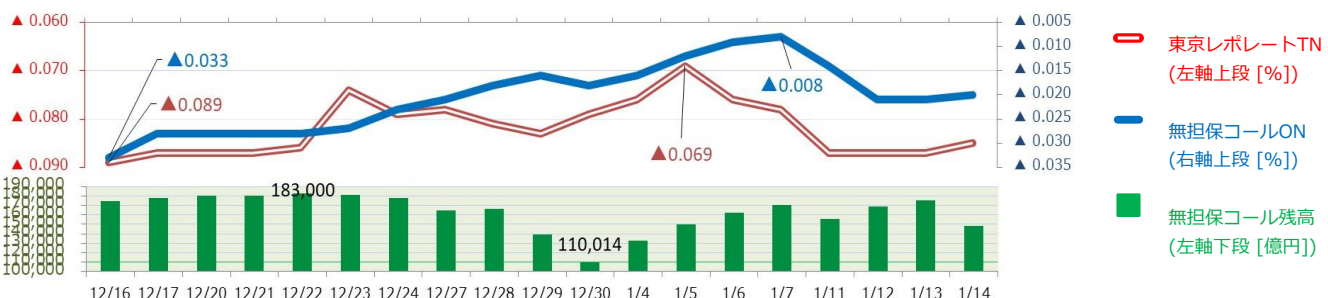
今月の国債買入オペ予定

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	1,000	2 7 14 19	12月20日	0
3年超5年以下	4750	1,000	2 14 19 26	12月20日	1
5年超10年以下	5500	3,000	7 14 19 26	12月20日	1
10年超25年以下	2500	1,000	7 19 26	12月20日	1
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<4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(登金)第243号 加入協会 日本証券業協会