



短期市場の推移

	12月15日	12月16日	12月19日	12月20日
加重平均金利	▲0.064	▲0.072	▲0.071	▲0.068
東京レポレート(TN)	▲0.093	▲0.089	▲0.091	▲0.090
無コール残	135,534	132,054	127,851	131,220
ON	69,762	68,632	63,049	64,669
その他	65,772	63,422	64,802	66,551
有コール残	31,686	31,308	30,357	30,743

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	▲0.087	0.001	▲0.067	▲0.099
T/N	-	-	-	▲0.129
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	-	▲0.131
2W	-	-	-	▲0.204
3W	-	-	-	▲0.178
1M	-	-	-	▲0.171
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.143
6M	-	-	-	▲0.130
1Y	-	-	-	▲0.112

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22日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	0:00 (米)12月消費者信頼感指数	101.0
-	-	16:00 (英)7-9月期国内総生産(GDP)改定値[前年比]	-
-	-	22:30 (米)7-9月期国内総生産(GDP)確定値[前期比年率]	2.9%

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▲0.073%~▲0.062%の水準で取引された。ビットサイドの調達意欲は堅調ななか、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.001%の▲0.067%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.086 ~ ▲0.085	▲0.075 ~ ▲0.068	▲0.075 ~ ▲0.055

翌営業日のマーケット

引き続きビットサイドの調達意欲は強く、出合水準は本日対比やや上昇を想定。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想
	12月21日	12月22日	12月21日	12月22日	12月23日
券	▲2,400	▲3,800	▲2,400	▲3,800	▲5,000
財政	▲5,700	+4,800	▲5,700	+4,800	▲2,000
過不足	▲8,100	+1,000	▲8,100	+1,000	▲7,000
金融調節	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド
国庫短期証券買入		+19,200		+1,000	
国債買入				+2,000	
CP等買入	▲200		▲300		
社債等買入			▲100		
国債補充供給	+26,700	▲37,900	+37,900		
新型コロナ対応金融支援特別					▲11,900
当座預金増減		▲300		+41,500	
当座預金残高		4,993,000		5,034,500	
準備預金残高		4,377,400		4,377,400	
積み終了先		4,372,700		流動性供給	
超過準備		4,372,500		機関貸元利回収	
非準備先残高		615,600		(財政資金の受け)	
準備預金進捗率		99.5%			
平均		19.4%			
乖離率		80.1%			

12月21日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
国庫短期証券買入(12/22~)	1,000	7,474	1,000	0.006	0.008	27.1
国債買入(固定利回り方式)(12/22~)						
5~10年	0	0				
5~10年	0	0				
国債補充供給(12/21~12/22)						
38,060	38,060	▲0.350	▲0.350			
117	117	▲0.350	▲0.350			
国債買入(12/22~)						
3~5年	1,000	4,166	1,000	0.062	0.064	
5~10年	1,000	5,332	1,002	0.051	0.055	85.3

マネタリーベース [億円]
12月20日時点 6,274,700

所要 [億円]
今積期の所要準備額 3,904,800
12月22日以降の残り所要
積数 20,200
平均 800

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

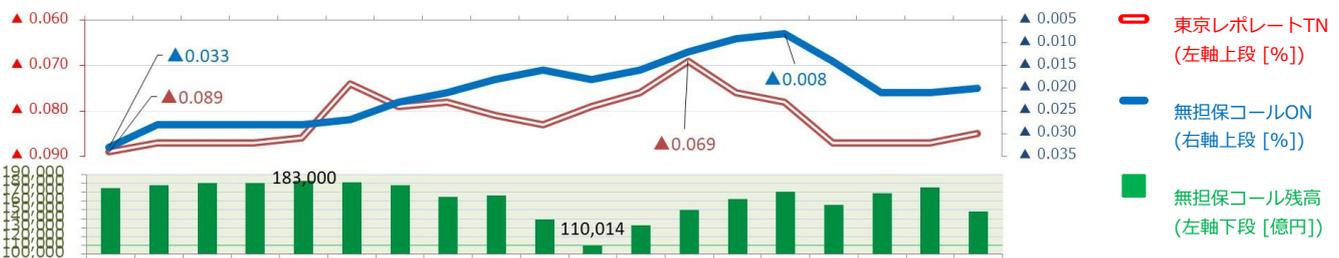
今月の国債買入オペ予定

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21日	1
5年超10年以下	5500	1,000	7 14 19 26	12月21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<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