



短期市場の推移

	12月21日	12月22日	12月23日	12月26日
加重平均金利	▲0.067	▲0.065	▲0.062	▲0.062
東京レポレート(TN)	▲0.129	▲0.118	▲0.123	▲0.122
無コール残	137,446	142,924	151,187	146,660
ON	68,815	73,694	78,927	72,950
その他	68,631	69,230	72,260	73,710
有コール残	30,569	30,606	30,512	29,594

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	▲0.053	▲0.089
T/N	-	-	-	▲0.095
S/N	-	-	-	-
1W	0.001	0.008	0.002	▲0.192
2W	-	-	▲0.065	▲0.179
3W	-	-	-	▲0.166
1M	-	-	-	▲0.159
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.149
6M	-	-	-	▲0.129
1Y	-	-	-	▲0.103

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28日の予定 (時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
8:50	11月鉱工業生産指数[前月比]	▲0.4%		-	
	金融政策決定会合における主な意見 (12月19~20日)			-	
				-	

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▲0.055%の合出から始まり、その後は主に▲0.058%~▲0.050%の水準で取引された。昨日に引き続き、大手行の調達ニーズが強くON物加重平均金利(速報)は前営業日+0.009%の▲0.053%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.055 ~ ▲0.050	▲0.050 ~ ▲0.050	▲0.058 ~ ▲0.053

翌営業日のマーケット

市場参加者の動向に大きな変化はなく、出合水準は本日対比横ばい圏を想定する。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	12月27日	12月28日	12月28日	12月29日	12月29日	12月29日
券	▲2,600	▲2,400	▲2,400	▲2,000	▲2,000	▲2,000
財政	+500	▲500	▲500	▲9,000	▲9,000	▲9,000
過不足	▲2,100	▲2,900	▲2,900	▲11,000	▲11,000	▲11,000
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		+18,100				
CP等買入	▲500		▲1,400			
国債補完供給	+27,800	▲28,900	+28,900			
当座預金増減		+14,400	+24,600	▲11,000		
当座預金残高		5,036,300	5,060,900	5,049,900		
準備預金残高		4,409,000	主な需給要因			
積み終了先		4,407,500				
超過準備		4,407,500				
非準備先残高		627,300				
準備預金進捗率		99.8%				
平均		38.7%				
乖離率		61.1%				

12月27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)(12/28~)						
5~10年	0	0				
5~10年	0	0				
米ドル資金供給(12/29~1/12)						
	0	0	4,590	4,590		
CP等買入(12/30~)						
	4,000	8,820	4,000	0.002	0.012	46.9
国債補完供給(12/27~12/28)						
	29,238	29,238	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マネタリーベース (億円)
12月26日時点 6,314,700

所要	今積期の所要準備額
12月28日以降の残り所要	3,904,800
積数	7,000
平均	400

国債短期証券入札予定

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

1月5日	10年
1月11日	30年
1月13日	5年
1月19日	20年

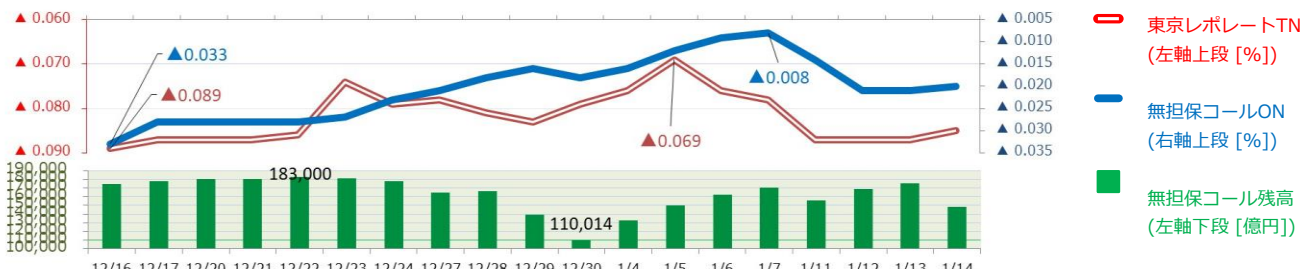
今月の国債買入オペ予定

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	5,750	2 14 19 26	12月26日	0
5年超10年以下	5500	6,750	7 14 19 26	12月26日	0
10年超25年以下	2500	3,000	7 19 26	12月26日	0
25年超	1000	2,000	2 14 26	12月26日	0
物価連動債	600	600	月1回	12月26日	0
変動利付債<四半期>	300	300	四半期に1回	10月17日	0

1年前の市場推移

○2021年12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