



短期市場の推移

	12月22日	12月23日	12月26日	12月27日
加重平均金利	▲0.065	▲0.062	▲0.062	▲0.053
東京レボレート(TN)	▲0.118	▲0.123	▲0.122	▲0.095
無コール残	142,924	151,187	146,660	154,403
ON	73,694	78,927	72,950	80,973
その他	69,230	72,260	73,710	73,430
有コール残	30,606	30,512	29,594	26,906

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

本日の市況

	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	▲0.080	0.001	▲0.047	▲0.089
T/N	-	-	-	▲0.092
S/N	-	-	▲0.020	-
1W	0.000	0.001	0.001	▲0.183
2W	-	-	0.010	▲0.172
3W	-	-	-	▲0.159
1M	-	-	-	▲0.154
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.147
6M	-	-	-	▲0.126
1Y	-	-	-	▲0.103

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29日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	22:30 (米)新規失業保険申請件数 [前週分]	-
-	-	-	-
-	-	-	-

経済指標及び予想値は株式会社フィスコ提供

本日の無担保コールON物は▲0.050%の出合から始まり、その後は主に▲0.050%～▲0.045%の水準で取引された。昨日同様に、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+0.006%の▲0.047%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.050 ~ ▲0.045	▲0.045 ~ ▲0.045	▲0.050 ~ ▲0.045

翌営業日のマーケット

引き続き大手行の調達ニーズが底堅く、出合水準は本対比横ばいから上昇を想定する。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	12月28日		12月29日		12月30日	
券	▲2,500		▲2,100		▲500	
財政	+100		▲7,600		▲2,000	
過不足	▲2,400		▲9,700		▲2,500	
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				+6,500		
CP等買入	▲1,400		▲200			
国債補完供給	+28,900	▲26,100	+26,100			
当座預金増減	▲1,000		+22,700		▲2,500	
当座預金残高	5,035,300		5,058,000		5,055,500	
準備預金残高	4,408,800		主な需給要因			
積み終了先	4,407,400					
超過準備	4,407,400					
非準備先残高	626,500					
準備預金進捗率	99.9%					
平均	41.9%					
乖離率	57.9%					

12月28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)(12/29~)						
5~10年	0	0				
5~10年	0	0				
1~3年	375	375				
3~5年	1,208	1,208				
国債買入(12/29~)						
1~3年	1,000	5,110	1,000	0.016	0.016	
3~5年	1,000	3,337	1,002	▲0.002	0.000	72.4
5~10年	3,000	13,304	3,003	▲0.002	0.003	45.4
国債補完供給(12/28~12/29)						
	26,495	26,495	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マネタリーベース (億円)

12月27日時点 6,331,600

所要

今積期の所要準備額 3,904,800

12月29日以降の残りの所要

積数 5,700

平均 300

国庫短期証券入札予定

1月5日	3ヶ月(第1129回)
1月6日	6ヶ月(第1130回)
1月10日	3ヶ月(第1131回)
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

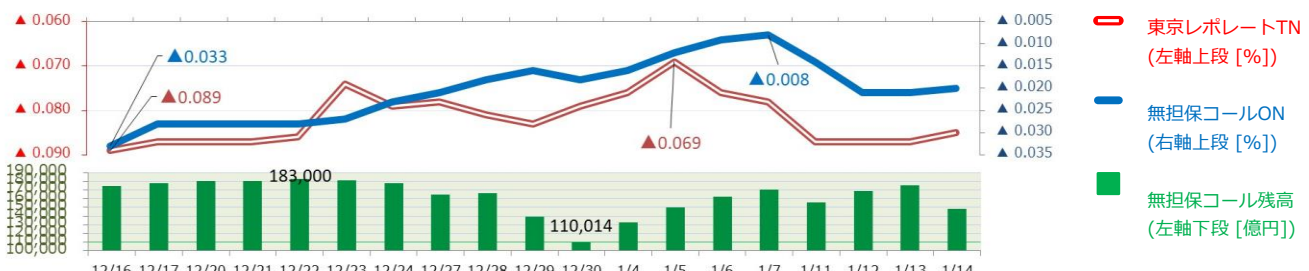
今月の国債買入オペ予定

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28日	0
3年超5年以下	4750	1,000	2 14 19 26	12月28日	0
5年超10年以下	5500	3,000	7 14 19 26	12月28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