



短期市場の推移

	12月23日	12月26日	12月27日	12月28日
加重平均金利	▲0.062	▲0.062	▲0.053	▲0.047
東京レボレート(TN)	▲0.123	▲0.122	▲0.095	▲0.092
無コール残	151,187	146,660	154,403	153,163
ON	78,927	72,950	80,973	80,383
その他	72,260	73,710	73,430	72,780
有コール残	30,512	29,594	26,906	29,028

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

	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	▲0.033	▲0.091
T/N	-	-	-	▲0.153
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	0.000	▲0.154
2W	▲0.070	▲0.050	▲0.067	▲0.147
3W	-	-	-	▲0.146
1M	▲0.050	0.000	▲0.025	▲0.142
2M	-	-	-	-
3M	-	-	0.005	▲0.144
6M	-	-	-	▲0.127
1Y	-	-	-	▲0.101

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30日の予定 (時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
19:00	12月の外国為替平衡操作の実施状況(財務省)			
	-		-	
	-		-	

本日の市況

本日の無担保コールON物は▲0.035%の出合から始まり、その後は主に▲0.040%~▲0.025%の水準で取引された。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+0.014%の▲0.033%となった。本日、日本銀行は貸付期間2年間の共通担保資金供給オペレーションを2023年1月4日にオファーすると発表した。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.045 ~ ▲0.028	- ~ -	▲0.050 ~ ▲0.025

翌営業日のマーケット

四半期末日のためビッドの減少が見込まれるが、大手行の調達ニーズは底堅く、出合水準は本日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29日	12月30日	12月30日	1月4日	
券	▲2,000	+500	+500	+3,000	
財政	▲7,400	▲5,500	▲5,500	▲25,000	
過不足	▲9,400	▲5,000	▲5,000	▲22,000	
金融調節	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド
国債買入	+6,500	+6,600	+6,600		
CP等買入	▲200	▲800	+4,000		
国債補完供給	+26,100	▲32,500	+32,500		
当座預金増減	▲9,500	+37,300	+37,300	▲22,000	
当座預金残高	5,025,800	5,063,100	5,063,100	5,041,100	
準備預金残高	4,417,900				主な需給要因
積み終了先	4,416,800				国債発行・償還
超過準備	4,416,700				(2年)
非準備先残高	607,900				
準備預金進捗率	99.9%				
平均	45.2%				
乖離率	54.7%				

12月29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)(12/30~)						
5~10年	0	0				
5~10年	0	0				
1~3年	460	460				
3~5年	74	74				
国債買入(12/30~)						
1~3年	1,000	5,203	1,000	0.017	0.019	50.0
3~5年	1,000	3,225	1,001	0.000	0.003	34.8
5~10年	1,000	5,492	1,009	0.013	0.015	63.0
5~10年	3,000	11,409	3,000	▲0.016	▲0.005	45.0
国債補完供給(12/29~12/30)						
	33,009	33,009	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マネタリーベース 12月28日時点 6,333,100

所要	所要
今積期の所要準備額	3,904,800
12月30日以降の残り所要	
積数	4,500
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

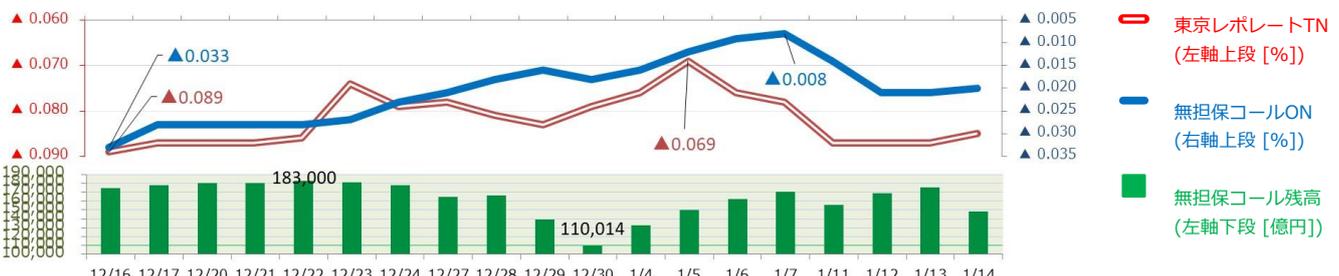
今月の国債買入オペ予定

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29日	0
3年超5年以下	4750	1,000	2 14 19 26	12月29日	0
5年超10年以下	5500	3,000	7 14 19 26	12月29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	-

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