



短期市場の推移

	12月26日	12月27日	12月28日	12月29日
加重平均金利	▲0.062	▲0.053	▲0.047	▲0.033
東京レボ レート(TN)	▲0.122	▲0.095	▲0.092	▲0.153
無コール残	146,660	154,403	153,163	153,422
ON	72,950	80,973	80,383	83,171
その他	73,710	73,430	72,780	70,251
有コール残	29,594	26,906	29,028	27,955

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 [%]

1月4日の予定 (時刻は日本時間)

日本			海外		
予想			予想		
	-			FOMC議事要旨 (12月13・14日開催分)	
	-			-	
	-			-	

経済指標及び予想値は株式会社フィスコ提供

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	▲0.022	▲0.091
T/N	-	-	-	▲0.094
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	0.000	▲0.110
2W	▲0.055	▲0.027	▲0.038	▲0.116
3W	-	-	▲0.040	▲0.122
1M	▲0.030	0.120	0.020	▲0.129
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.138
6M	-	-	-	▲0.123
1Y	-	-	-	▲0.101

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

本日の市況

本日の無担保コールON物は▲0.025%の出合から始まり、その後は主に▲0.025%～▲0.015%の水準で取引された。年末初のためビッドを控える先も散見されたが、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+0.011%の▲0.022%となった。

[％]		
都銀・信託	証券	地銀
▲ 0.025 ～ ▲ 0.015	- ～ -	▲ 0.025 ～ ▲ 0.015

翌営業日のマーケット

翌営業日もビッドサイドの調達ニーズが底堅く、出会いの中心は本日対比で上昇と予想。

資金需給

	日銀速報	日銀予想	当社需給予想
	12月30日	1月4日	1月5日
券	+700	+2,600	+3,000
財政	▲8,300	▲26,200	+0
過不足	▲7,600	▲23,600	+3,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国債買入	+6,600	+10,000	スタート
CP等買入	▲800	+4,000	
国債補完供給	+32,500	▲35,600	+35,600
当座預金増減	▲900	+22,000	+3,000
当座預金残高	5,024,900	5,046,900	5,049,900
準備預金残高	4,425,700	主な需給要因 国債発行・償還（2年）	
積み終了先	4,425,600		
超過準備	4,425,000		
非準備先残高	599,200		
準備預金進捗率	99.9%		
平均	61.3%		
乖離率	38.6%		

12月30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)(1/4~)		
5~10年	0	0
5~10年	0	0
1~3年	0	0
3~5年	0	0

国債買入(1/4~)							
1~3年	3,000	9,192	3,002	▲0.007	▲0.004	47.7	
3~5年	1,000	2,855	1,000	▲0.032	▲0.025	8.0	
5~10年	3,000	11,445	3,001	▲0.038	▲0.032	92.3	
10~25年	3,000	5,276	3,001	▲0.088	▲0.059	89.1	
国債補完供給(12/30~1/4)							
	36,084	36,084	▲0.450	▲0.450			
	0	0					

マネタリーベース	所要
12月29日時点 6,325,700	今積期の所要準備額 3,904,800
	1月4日以降の残り所要
	積数 800
	平均 100

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

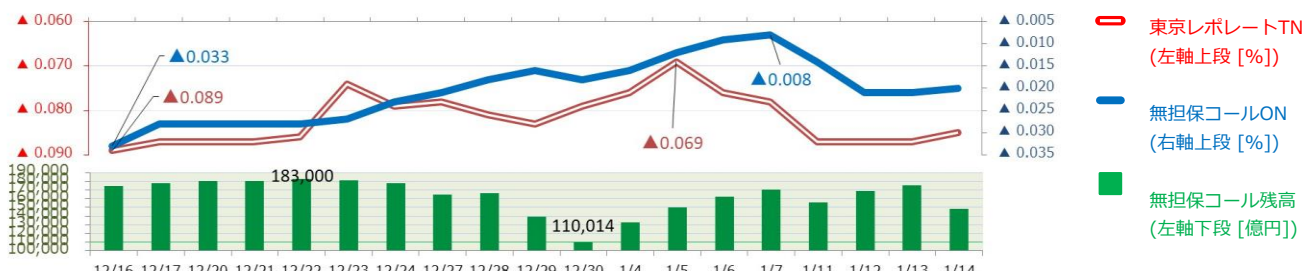
来月の国債買入オペ予定

オペ種類	一回当たりオフア-金額	直近オフア-額	オフア-予定日					直近日	残り回数
1年以下	1500	1,500	月1回					12月2日	1
1年超3年以下	4,250~5,750	3,000	6	12	20	25		12月30日	4
3年超5年以下	5,000~6,000	1,000	6	20	25	30		12月30日	4
5年超10年以下	5,750~7,750	3,000	12	20	25	30		12月30日	4
10年超25年以下	2,000~4,000	3,000	6	12	25	30		12月30日	4
25年超	1,000~3,000	2,000	12	20	30			12月26日	3
物価連動債	600	600	月1回					12月26日	1
変動利付債<四半期>	300	300	四半期に1回					10月17日	1

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、前営業日のシート・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あります。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行うようお願いいたします。当社は、いかなる投資の勧誘行為においても証券商としての資格を有していません。記載された意見や予測等は作成時点での仮定、正確性、完全性を保証するものではありません。今後予告なく変更されることがあります。

当八大資本株式会社 登録有価証券販売 近藤利光氏(券令 第24号 加配日本 日本証券業協会)