



短期市場の推移

	12月27日	12月28日	12月29日	12月30日
加重平均金利	▲0.053	▲0.047	▲0.033	▲0.022
東京レポレート(TN)	▲0.095	▲0.092	▲0.153	▲0.094
無コール残	154,403	153,163	153,422	112,220
ON	80,973	80,383	83,171	72,972
その他	73,430	72,780	70,251	39,248
有コール残	26,906	29,028	27,955	25,115

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	▲0.038	▲0.091
T/N	-	-	-	▲0.096
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.035	▲0.030	▲0.034	▲0.105
2W	▲0.070	0.180	▲0.040	▲0.114
3W	-	-	-	▲0.118
1M	▲0.060	0.150	▲0.028	▲0.124
2M	-	-	▲0.025	-
3M	-	-	-	▲0.135
6M	-	-	-	▲0.120
1Y	-	-	-	▲0.100

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

1月5日の予定 (時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
8:50	12月マナタリーベース (日銀)	-	19:00 (欧)11月生産者物価指数 [前年比]	-
15:00	財政資金対民間収支 12月実績 (財務省)	-	22:15 (米)12月ADP全米雇用報告	14.8万人
			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

本日の市況

本日の無担保コールON物は▲0.030%の合出から始まり、その後は主に▲0.040%~▲0.025%の水準で取引された。大手行の調達ニーズが弱まったことで、ON物加重平均金利(速報)は前営業日▲0.016%の▲0.038%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.070 ~ ▲0.060	▲0.040 ~ ▲0.040	▲0.045 ~ ▲0.025

翌営業日のマーケット

地銀調達ニーズは堅調も大手行の調達ニーズは弱く、出合の中心の水準は本日対比やや低下と予想。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	1月4日	1月5日	1月5日	1月6日	1月6日	1月7日
券	+2,500	+2,800	+2,800	+2,000		
財政	▲22,500	▲5,300	▲5,300	▲64,000		
過不足	▲20,000	▲2,500	▲2,500	▲62,000		
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		+10,000		+6,100		
共通担保(全店)				+10,000		
国債補充供給	+35,600	▲33,100	+33,100			
当座預金増減	▲7,500	+46,700	+46,700	▲62,000		
当座預金残高	5,017,400	5,064,100	5,064,100	5,002,100		
準備預金残高	4,374,800	主な需給要因				
積み終了先	4,374,700	国庫短期証券				
超過準備	4,374,700	発行・償還(3M)				
非準備先残高	642,600	国債発行(10年)				
準備預金進捗率	99.9%	法人税揚げ				
平均	64.5%					
乖離率	35.4%					

1月4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)(1/5~)						
5~10年	0	0				
5~10年	0	0				
国債買入(1/5~)						
1~3年	2,000	7,265	2,003	▲0.005	▲0.004	52.1
3~5年	1,000	3,433	1,000	▲0.025	▲0.018	12.0
5~10年	1,500	6,142	1,504	0.011	0.012	90.8
10~25年	1,500	5,244	1,504	0.002	0.005	3.8
国債補充供給(1/4~1/5)						
	33,490	33,490	▲0.350	▲0.350		
	117	117	▲0.350	▲0.350		
共通担保(全店)(2023/1/5~2025/1/6)						
	10,000	58,267	10,016		17.2	

マナタリーベース (億円) 12月30日時点 6,324,100

所要	(億円)
今積期の所要準備額	3,904,800
1月5日以降の残り所要	
積数	700
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

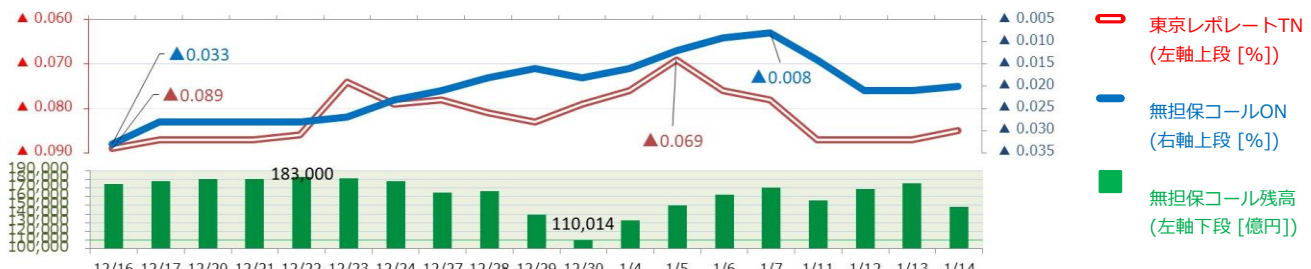
今月の国債買入オペ予定

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	1
1年超3年以下	4,250~5,750	2,000	6 12 20 25	12月4日	4
3年超5年以下	5,000~6,000	1,000	6 20 25 30	1月4日	4
5年超10年以下	5,750~7,750	1,500	12 20 25 30	1月4日	4
10年超25年以下	2,000~4,000	1,500	6 12 25 30	1月4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