



短期市場の推移

	12月4日	12月5日	12月6日	12月7日
加重平均金利	▲0.013	▲0.011	▲0.010	▲0.010
東京レポレート(TN)	▲0.100	▲0.086	▲0.090	▲0.088
無コール残	167,338	166,858	166,008	162,933
ON	92,086	91,276	91,426	88,411
その他	75,252	75,582	74,582	74,522
有コール残	30,124	28,189	27,669	28,873

[億円] [%]

12月11日の予定 (時刻は日本時間)

日本		予想	海外	予想
8:50	マネーストック (11月)		-	
	-		-	
	-		-	

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	▲0.010	▲0.082
T/N	-	-	-	▲0.085
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.040	0.008	▲0.013	▲0.111
2W	-	-	▲0.025	▲0.123
3W	-	-	▲0.013	▲0.158
1M	0.020	0.150	0.107	▲0.171
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.159
6M	-	-	-	▲0.119
1Y	-	-	-	▲0.078

本日の市況

無担保コールON物は▲0.007%の出会いから始まり、その後は主に▲0.015%~▲0.005%を中心に取引された。引き続きビッドサイドの資金調達意欲は強く、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比横ばいの▲0.010%となった。

都銀・信託	証券	地銀
- ~ -	▲0.008 ~ ▲0.010	▲0.015 ~ ▲0.005

翌営業日のマーケット

引き続きビッドサイドの調達意欲は旺盛であり、出会いの水準は本日対比横ばい圏を予想する。

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

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想
	12月8日	12月11日	12月11日	12月12日	12月12日
券	▲1,600	▲1,000	▲1,000	▲2,000	▲2,000
財政	▲1,600	▲13,300	▲13,300	+5,000	+5,000
過不足	▲3,200	▲14,300	▲14,300	+3,000	+3,000
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			+14,800		
CP等買入	▲200				
社債等買入	▲100				
国債補充供給	+37,800	▲37,200	+37,200		+4,000
当座預金増減	▲2,900	+37,700	+37,700	+7,000	+7,000
当座預金残高	5,295,900	5,333,600	5,333,600	5,340,600	5,340,600
準備預金残高	4,621,200				
積み終了先	4,621,000	国庫短期証券発行・償還(3M・6M)			
超過準備	4,620,900				
非準備先残高	674,700				
準備預金進捗率	99.9%				
平均	83.3%				
乖離率	16.6%				

12月8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(12/11~)	1~3年	3~5年	5~10年	10~25年	平均	按分
1~3年	3,750	5,898	3,750	0.007	0.012	18.0
3~5年	4,500	10,512	4,505	0.031	0.034	18.3
5~10年	5,250	5,915	5,251	0.012	0.037	20.0
10~25年	1,500	1,511	1,500	▲0.016	0.063	89.0

国債補充供給(12/8~12/11)	12/8	12/9	12/10	12/11
37,703	37,703	▲0.350	▲0.351	
0	0			

マナタリーベース	所要
12月7日時点 6,562,000	今積期の所要準備額 3,895,300
	12月11日以降の残り所要
	積数 1,700
	平均 300

国庫短期証券入札予定

12月15日	3ヶ月(第1201回)
12月18日	1年
12月22日	3ヶ月
1月5日	3ヶ月

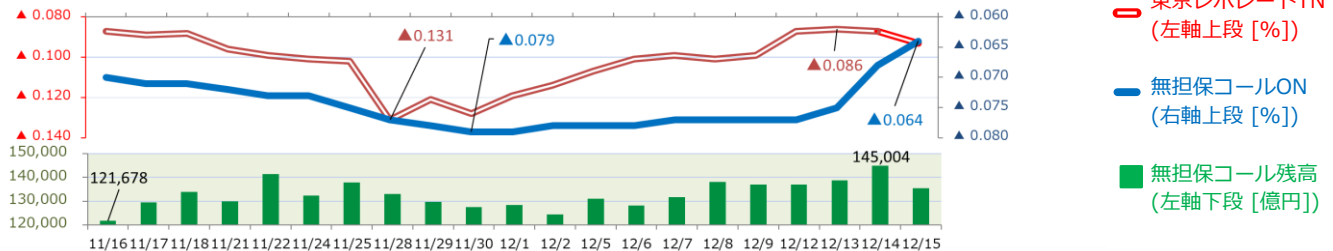
今月の国債買入オペ予定

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	11月10日	1
1年超3年以下	3,500~6,500	3,750	4 8 13 18	12月8日	2
3年超5年以下	4,000~7,500	4,500	4 8 18 25	12月8日	2
5年超10年以下	4,500~9,000	5,250	8 13 18 25	12月8日	3
10年超25年以下	1,000~5,000	1,500	4 8 18 25	12月8日	2
25年超	500~3,500	750	4 13 25	12月4日	2
物価連動債	600	600	月1回	11月29日	1
変動利付債	-	300	-	4月14日	-

1年前の市場推移

○2022年11月積み期 [11月16日~12月15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