



短期市場の推移

	12月6日	12月7日	12月8日	12月11日
加重平均金利	▲0.010	▲0.010	▲0.010	▲0.011
東京レボレート(TN)	▲0.090	▲0.088	▲0.085	▲0.086
無コール残	166,008	162,933	162,195	155,926
ON	91,426	88,411	87,013	80,149
その他	74,582	74,522	75,182	75,777
有コール残	27,669	28,873	29,873	27,719

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	▲0.065	0.001	▲0.010	▲0.085
T/N	-	-	-	▲0.086
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.025	▲0.013	▲0.023	▲0.107
2W	-	-	▲0.020	▲0.122
3W	-	-	-	▲0.171
1M	-	-	-	▲0.169
2M	-	-	0.025	-
3M	-	-	-	▲0.153
6M	-	-	-	▲0.112
1Y	-	-	-	▲0.076

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13日の予定 (時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
8:50	日銀短観概要(12月)		(米) FOMC	
	-		(米) パウエルFRB議長の会見	
	-		-	

本日の市況

無担保コールON物は▲0.008%の出合いから始まり、その後は主に▲0.010%~▲0.005%を中心に取引された。引き続きビット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0.001%上昇の▲0.010%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.008 ~ ▲0.008	- ~ -	▲0.01 ~ ▲0.005

翌営業日のマーケット

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

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	12月12日	12月13日	12月12日	12月13日	12月14日	12月15日
券	▲1,500	▲1,600	▲1,500	▲1,600	▲3,000	▲3,000
財政	+4,400	▲17,500	+4,400	▲17,500	+4,000	+4,000
過不足	+2,900	▲19,100	+2,900	▲19,100	+1,000	+1,000
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
CP等買入	▲500	+4,000	▲200	+4,000		
国債補充供給	+36,400	▲37,700	+37,700	▲37,700		
当座預金増減	+5,100	+18,400	+5,100	+18,400	+1,000	+1,000
当座預金残高	5,302,100	5,320,500	5,302,100	5,320,500	5,321,500	5,321,500
準備預金残高	4,671,200	4,670,900	4,671,200	4,670,900	4,671,200	4,670,900
積み終了先	4,670,900	4,670,800	4,670,900	4,670,800	4,670,900	4,670,800
超過準備	4,670,800	630,900	4,670,800	630,900	4,670,800	630,900
非準備先残高	630,900	99.9%	630,900	99.9%	630,900	99.9%
準備預金進捗率	99.9%	90.0%	99.9%	90.0%	99.9%	90.0%
平均	90.0%	9.9%	90.0%	9.9%	90.0%	9.9%
乖離率	9.9%		9.9%		9.9%	

12月12日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
米ドル資金供給(12/14~12/21)	1	1	5,580	5,580		
国債補充供給(12/12~12/13)	38,158	38,158	▲0.350	▲0.351		
米ドル資金供給用担保国債供給(12/13~12/22)	5,000	2	2	▲0.100	▲0.100	

マナリーベース	所要
12月11日時点	6,562,800
今積期の所要準備額	3,895,300
12月13日以降の残り所要	積数 600
	平均 200

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(第1202回)
12月22日	3ヶ月
1月5日	3ヶ月
12月14日	20年
12月26日	2年
1月10日	10年
1月12日	30年

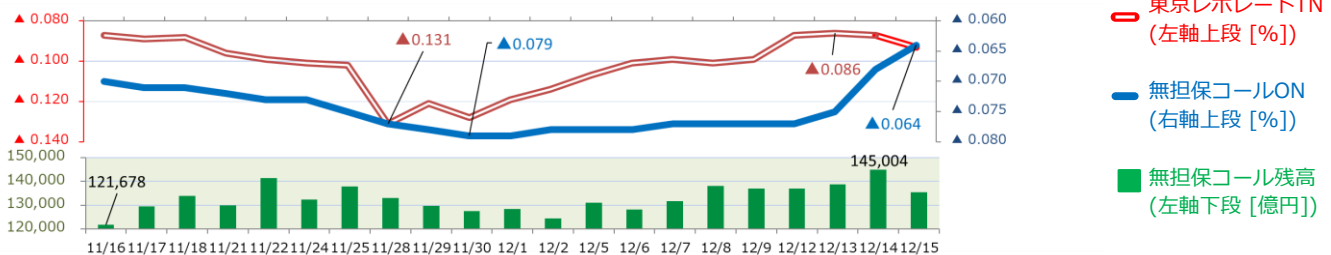
今月の国債買入オペ予定

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	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