



短期市場の推移

	12月7日	12月8日	12月11日	12月12日
加重平均金利	▲0.010	▲0.010	▲0.011	▲0.010
東京レポレート(TN)	▲0.088	▲0.085	▲0.086	▲0.086
無コール残	162,933	162,195	155,926	152,715
ON	88,411	87,013	80,149	77,503
その他	74,522	75,182	75,777	75,212
有コール残	28,873	29,873	27,719	29,019

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	▲0.060	0.001	▲0.009	▲0.086
T/N	-	-	-	▲0.086
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.023	0.008	▲0.016	▲0.105
2W	▲0.028	▲0.013	▲0.025	▲0.124
3W	-	-	-	▲0.172
1M	-	-	-	▲0.168
2M	0.020	0.025	0.023	-
3M	-	-	0.040	▲0.152
6M	-	-	-	▲0.109
1Y	-	-	-	▲0.075

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

12月14日の予定 (時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
8:50	12月調査の日銀短観(全容)		22:30	(米) 11月の小売売上高
13:30	10月の鉱工業生産確報			(欧) ECB理事会 ラガルトECB総裁の会見

本日の市況

無担保コールON物は▲0.006%の出合いから始まり、その後は主に▲0.010%~▲0.004%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0.001%上昇の▲0.009%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.008 ~ ▲0.006	- ~ -	▲0.010 ~ ▲0.004

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底堅く、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13日	12月14日	12月13日	12月14日	12月13日	12月14日
券	▲1,600	▲2,600	▲1,600	▲2,600	▲2,000	▲2,000
財政	▲17,400	+4,100	▲17,400	+4,100	+65,000	+65,000
過不足	▲19,000	+1,500	▲19,000	+1,500	+63,000	+63,000
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				+11,400		
CP等買入	▲200		▲300			
社債等買入			▲200			
国債補完供給	+37,700	▲33,600	+33,600			
貸出増加支援					▲20,600	
当座預金増減	▲15,100	+46,000	▲15,100	+46,000	+42,400	+42,400
当座預金残高	5,287,000	5,333,000	5,287,000	5,333,000	5,375,400	5,375,400
準備預金残高	4,645,800		4,645,800			
積み終了先	4,645,500		4,645,500			
超過準備	4,645,400		4,645,400			
非準備先残高	641,200		641,200			
準備預金進捗率	99.9%		99.9%			
平均	93.3%		93.3%			
乖離率	6.6%		6.6%			

12月13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(12/14~)	~1年	1~3年	5~10年	25年
~1年	1,500	2,480	1,500	▲0.050 ▲0.018 5.2
1~3年	3,750	10,840	3,759	▲0.012 ▲0.010 94.8
5~10年	5,250	12,350	5,255	▲0.036 ▲0.034 89.0
25年	750	2,114	751	▲0.046 ▲0.038 41.4

国債補完供給(12/13~12/14)	12/13	12/14
33,688	33,688	▲0.350 ▲0.351
433	433	▲0.350 ▲0.357

マネタリーベース	12月12日時点
6,569,300	

所要	今積期の所要準備額
12月14日以降の残り所要	3,895,300
積数	200
平均	100

国債短期証券入札予定

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

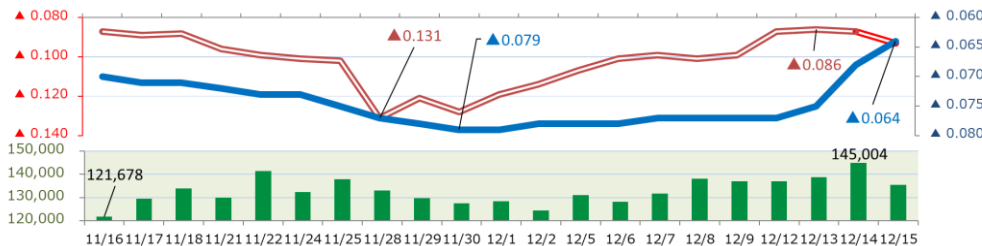
今月の国債買入オペ予定

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13日	0
1年超3年以下	3,500~6,500	3,750	4 8 13 18	12月13日	1
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13日	2
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13日	1
物価運動債	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。



東京レポレート TN (左軸上段 [%])
 無担保コールON (右軸上段 [%])
 無担保コール残高

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