



短期市場の推移

	12月8日	12月11日	12月12日	12月13日
加重平均金利	▲0.010	▲0.011	▲0.010	▲0.009
東京レボレート(TN)	▲0.085	▲0.086	▲0.086	▲0.086
無コール残	162,195	155,926	152,715	148,919
ON	87,013	80,149	77,503	73,157
その他	75,182	75,777	75,212	75,762
有コール残	29,873	27,719	29,019	30,805

[億円] [%]

12月15日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	(米) 11月のNY連銀製造業指数	-
-	-	(米) 11月の鉱工業指数	-
-	-	-	-

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	▲0.085	0.001	▲0.008	▲0.101
T/N	-	-	-	▲0.117
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.030	▲0.008	▲0.019	▲0.140
2W	▲0.025	▲0.008	▲0.020	▲0.149
3W	-	-	-	▲0.185
1M	-	-	-	▲0.181
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.152
6M	-	-	-	▲0.108
1Y	-	-	-	▲0.076

本日の市況

無担保コールON物は▲0.005%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▲0.008%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.006 ~ ▲0.005	- ~ -	▲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。

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

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	12月14日	12月15日	12月14日	12月15日	12月18日	12月18日
券	▲2,600	▲1,200	▲2,600	▲1,200	▲2,000	▲2,000
財政	+4,400	+68,000	+4,400	+68,000	+1,000	+1,000
過不足	+1,800	+66,800	+1,800	+66,800	▲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
国債買入		+11,400				
CP等買入	▲300		▲1,300			
社債等買入	▲200		▲100			
国債補充供給	+33,600	▲34,800	+34,800			
貸出増加支援			▲22,700	+51,100		
当座預金増減	+11,500	+128,600	+11,500	+128,600	▲1,000	▲1,000
当座預金残高	5,298,500	5,427,100	5,298,500	5,427,100	5,426,100	5,426,100
準備預金残高	4,629,500		4,629,500			
積み終了先	4,629,500		4,629,500			
超過準備	4,629,400		4,629,400			
非準備先残高	669,000		669,000			
準備預金進捗率	99.9%		99.9%			
平均	96.7%		96.7%			
乖離率	3.2%		3.2%			

12月14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
------	------	----	----	----	----	----

社債等買入(12/19~)

1,000 1,810 1,000 0.340 0.375 95.2

国債補充供給(12/14~12/15)

35,122 35,122 ▲0.350 ▲0.351

0 0

マネタリーベース

12月13日時点 6,555,900

所要

今積期の所要準備額 3,895,300

12月15日以降の残り所要

積数 100

平均 100

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

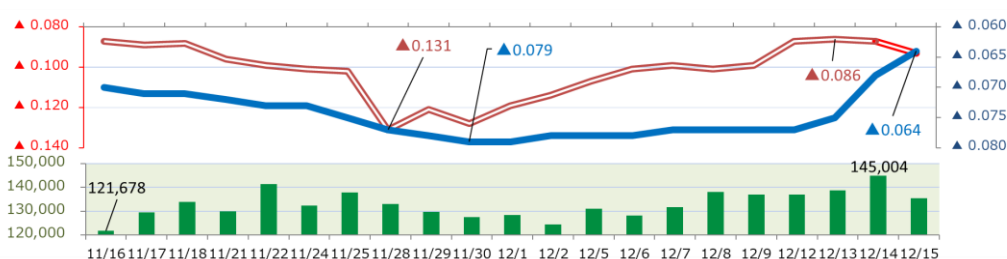
今月の国債買入オペ予定

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。



東京レボレートTN (左軸上段 [%])

無担保コールON (右軸上段 [%])

無担保コール残高 (左軸下段 [億円])

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