



短期市場の推移

	12月11日	12月12日	12月13日	12月14日
加重平均金利	▲0.011	▲0.010	▲0.009	▲0.008
東京レボレート(TN)	▲0.086	▲0.086	▲0.086	▲0.117
無コール残	155,926	152,715	148,919	149,726
ON	80,149	77,503	73,157	75,064
その他	75,777	75,212	75,762	74,662
有コール残	27,719	29,019	30,805	29,247

[億円] [%]

12月18日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
日銀金融政策決定会合 (1日目)			

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	▲0.087	0.001	▲0.009	▲0.132
T/N	-	-	-	▲0.118
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.018	▲0.010	▲0.012	▲0.146
2W	▲0.028	▲0.010	▲0.018	▲0.184
3W	-	-	-	▲0.185
1M	0.050	0.150	0.083	▲0.171
2M	-	-	0.010	-
3M	-	-	-	▲0.149
6M	-	-	-	▲0.107
1Y	-	-	-	▲0.073

本日の市況

無担保コールON物は▲0.007%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。本日は積み期最終日となったが、引き続きビッドサイドの資金調達意欲は底堅く、ON物加重平均金利(速報)は、前営業日対比▲0.001%低下の▲0.009%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

新積み期初日であり、ビッドサイドの様子見姿勢から、出合いの水準は本日対比低下すると予想。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想
	12月15日	12月18日	12月15日	12月18日	12月19日
券	▲1,200	▲1,500	▲1,500	▲1,500	▲3,000
財政	+69,500	▲200	▲200	▲200	▲5,000
過不足	+68,300	▲1,700	▲1,700	▲1,700	▲8,000
金融調節	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド
共通担保(全店)					▲6,300
CP等買入	▲1,300		▲100		
社債等買入	▲100				
国債補完供給	+34,800	▲41,500	+41,500		
貸出増加支援	▲22,700	+51,100			
当座預金増減	+88,600	+39,700	+39,700	+39,700	▲14,300
当座預金残高	5,387,100	5,426,800	5,426,800	5,426,800	5,412,500
準備預金残高	4,688,300	4,688,300	4,688,300	4,688,300	4,688,300
積み終了先	4,688,300	4,688,300	4,688,300	4,688,300	4,688,300
超過準備	4,688,200	4,688,200	4,688,200	4,688,200	4,688,200
非準備先残高	698,800	698,800	698,800	698,800	698,800
準備預金進捗率	100.0%	100.0%	100.0%	100.0%	100.0%
平均	100.0%	100.0%	100.0%	100.0%	100.0%
乖離率	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%

12月15日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
国債補完供給(12/15~12/18)	41,913	41,913	▲0.350	▲0.351		
	0	0				

マナリーベース [億円]
12月14日時点 6,570,000

所要	[億円]
来積期の所要準備額	3,969,100
12月18日以降の残り所要	
積数	108,300
平均	3,700

国庫短期証券入札予定

12月18日	1年 (第1202回)
12月22日	3ヶ月 (第1203回)
1月5日	3ヶ月
1月9日	6ヶ月

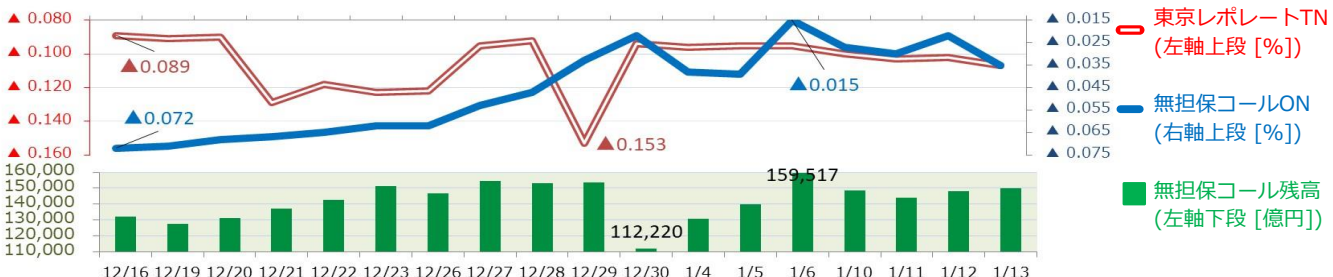
今月の国債買入オペ予定

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12月積み期 [12月16日~1月13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