



短期市場の推移

	12月13日	12月14日	12月15日	12月18日
加重平均金利	▲0.009	▲0.008	▲0.009	▲0.013
東京レボレート(TN)	▲0.086	▲0.117	▲0.118	▲0.148
無コール残	148,919	149,726	151,977	162,806
ON	73,157	75,064	77,965	84,914
その他	75,762	74,662	74,012	77,892
有コール残	30,805	29,247	25,870	26,194

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	▲0.010	▲0.207
T/N	-	-	▲0.009	▲0.169
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.023	▲0.010	▲0.022	▲0.168
2W	-	-	-	▲0.241
3W	-	-	-	▲0.207
1M	-	-	-	▲0.189
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.147
6M	-	-	-	▲0.112
1Y	-	-	-	▲0.067

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20日の予定 (時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
8:50	貿易収支 (11月)		(米) 消費者信頼感指数 (12月)	
	-		-	
	-		-	

本日の市況

無担保コールON物は▲0.005%の合から始まり、その後は主に▲0.015%~▲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0.003%上昇の▲0.010%となった。

	都銀・信託	証券	地銀
	- ~ -	- ~ -	▲0.015 ~ ▲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19日	12月20日	12月20日	12月21日	12月21日	12月21日
券	▲2,100	▲2,400	▲2,400	▲4,000	▲4,000	▲4,000
財政	▲800	+48,300	+48,300	+2,000	+2,000	+2,000
過不足	▲2,900	+45,900	+45,900	▲2,000	▲2,000	▲2,000
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		+15,100				
共通担保(全店)	▲6,300	+12,600				
CP等買入			▲200			
社債等買入		+1,000	▲2,100			
国債補充供給	+42,100	▲44,400	+44,400			
当座預金増減		+17,200	+88,000	▲2,000	▲2,000	▲2,000
当座預金残高		5,402,700	5,490,700	5,488,700	5,488,700	5,488,700
準備預金残高		4,706,700				
積み終了先		4,693,100	国庫短期債発行・償還(1Y)	流動性供給		
超過準備		4,690,200				
非準備先残高		696,000	国債償還(5年・10年・20年)			
準備預金進捗率		98.9%				
平均		12.9%				
乖離率		86.0%				

12月19日のオペ結果

12月19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
米ドル資金供給(12/21~12/28)	2	2	5,580	5,580		
国債補充供給(12/19~12/20)	44,726	44,726	▲0.350	▲0.351		
	0	0				

マネタリーベース [億円]
12月18日時点 6,659,700

所要	[億円]
今積期の所要準備額	3,969,100
12月20日以降の残り所要	
積数	44,700
平均	1,700

国庫短期証券入札予定

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

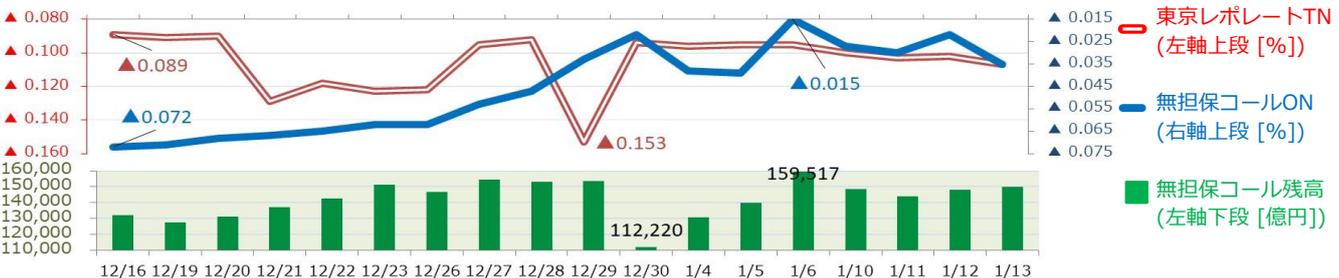
今月の国債買入オペ予定

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18日	0
3年超5年以下	4,000~7,500	4,500	4 8 18 25	12月18日	1
5年超10年以下	4,500~9,000	5,250	8 13 18 25	12月18日	1
10年超25年以下	1,000~5,000	1,500	4 8 18 25	12月18日	1
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