



### 短期市場の推移

	12月14日	12月15日	12月18日	12月19日
加重平均金利	▲0.008	▲0.009	▲0.013	▲0.010
東京レポレート(TN)	▲0.117	▲0.118	▲0.148	▲0.169
無コール残	149,726	151,977	162,806	169,573
ON	75,064	77,965	84,914	89,411
その他	74,662	74,012	77,892	80,162
有コール残	29,247	25,870	26,194	23,419

[億円] [%]

### 12月21日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
		(米) GDP3次速報値 (7~9月)	

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	▲0.087	0.001	▲0.010	▲0.205
T/N	-	-	▲0.009	▲0.162
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.030	0.030	▲0.015	▲0.167
2W	▲0.020	0.010	▲0.007	▲0.245
3W	-	-	0.010	▲0.206
1M	-	-	-	▲0.196
2M	-	-	-	-
3M	-	-	0.025	▲0.147
6M	-	-	-	▲0.112
1Y	-	-	-	▲0.067

### 本日の市況

無担保コールON物は▲0.007%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、前営業日対比横ばいの▲0.010%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.015 ~ ▲0.015	▲0.010 ~ ▲0.010	▲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。

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

### 資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	12月20日	12月21日	12月21日	12月22日	12月22日	12月22日
券	▲2,400	▲3,000	▲3,000	▲3,000	▲3,000	▲3,000
財政	+47,200	▲400	▲400	▲400	+5,000	+5,000
過不足	+44,800	▲3,400	▲3,400	▲3,400	+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
CP等買入	▲200		▲500			
社債等買入	▲2,100					
国債補完供給	+44,400	▲42,900	+42,900			
当座預金増減	+44,000	+39,000	+39,000	+39,000	+2,000	+2,000
当座預金残高	5,446,700	5,485,700	5,485,700	5,485,700	5,487,700	5,487,700
準備預金残高	4,747,600					
積み終了先	4,740,000					
超過準備	4,737,300					
非準備先残高	699,100					
準備預金進捗率	99.1%					
平均	16.1%					
乖離率	83.0%					

### 12月20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
国債補完供給(12/20~12/21)	42,098	42,098	▲0.450	▲0.450		
	1,193	1,193	▲0.450	▲0.450		

マナタリベース [億円]  
12月19日時点 6,679,100

所要	[億円]
今積期の所要準備額	3,969,100
12月21日以降の残り所要	
積数	34,400
平均	1,300

### 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