



短期市場の推移

	12月18日	12月19日	12月20日	12月21日
加重平均金利	▲0.013	▲0.010	▲0.010	▲0.011
東京レボレート(TN)	▲0.148	▲0.169	▲0.162	▲0.129
無コール残	162,806	169,573	177,945	178,269
ON	84,914	89,411	91,263	87,647
その他	77,892	80,162	86,682	90,622
有コール残	26,194	23,419	23,018	25,360

[億円] [%]

12月25日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	-	-
-	-	-	-
-	-	-	-

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	▲0.104
T/N	-	-	▲0.008	▲0.119
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.024	▲0.010	▲0.013	▲0.261
2W	-	-	-	▲0.234
3W	-	-	-	▲0.201
1M	-	-	-	▲0.193
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.156
6M	-	-	-	▲0.112
1Y	-	-	-	▲0.067

本日の市況

無担保コールON物は▲0.005%の合出から始まり、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%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旺盛であり、合出の水準は本日対比横這い圏を予想する。

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22日	12月25日	12月22日	12月25日	12月26日	12月26日
券	▲2,700	▲2,500	▲2,700	▲2,500	▲3,000	▲3,000
財政	+3,800	+7,000	+3,800	+7,000	+2,000	+2,000
過不足	+1,100	+4,500	+1,100	+4,500	+5,000	+5,000
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	▲400	▲400	▲400	▲400	▲400	▲400
社債等買入	▲700	▲100	▲700	▲100	▲700	▲100
国債補完供給	+35,800	+35,700	+35,800	+35,700	+35,800	+35,700
当座預金増減	+100	+39,700	+100	+39,700	+100	+39,700
当座預金残高	5,448,600	5,488,300	5,448,600	5,488,300	5,448,600	5,488,300
準備預金残高	4,729,600	4,729,600	4,729,600	4,729,600	4,729,600	4,729,600
積み終了先	4,727,400	4,727,400	4,727,400	4,727,400	4,727,400	4,727,400
超過準備	4,726,800	4,726,800	4,726,800	4,726,800	4,726,800	4,726,800
非準備先残高	719,000	719,000	719,000	719,000	719,000	719,000
準備預金進捗率	99.5%	99.5%	99.5%	99.5%	99.5%	99.5%
平均	29.0%	29.0%	29.0%	29.0%	29.0%	29.0%
乖離率	70.4%	70.4%	70.4%	70.4%	70.4%	70.4%

12月22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(12/22~12/25)	35,938	35,938	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マナタリーベース	所要
12月21日時点 6,730,200	今積期の所要準備額 3,969,100
	12月25日以降の残り所要
	積数 21,000
	平均 1,000

国庫短期証券入札予定

1月5日	3ヶ月
1月9日	6ヶ月
1月12日	3ヶ月
1月18日	1年
12月26日	2年
1月10日	10年
1月12日	30年
1月16日	5年

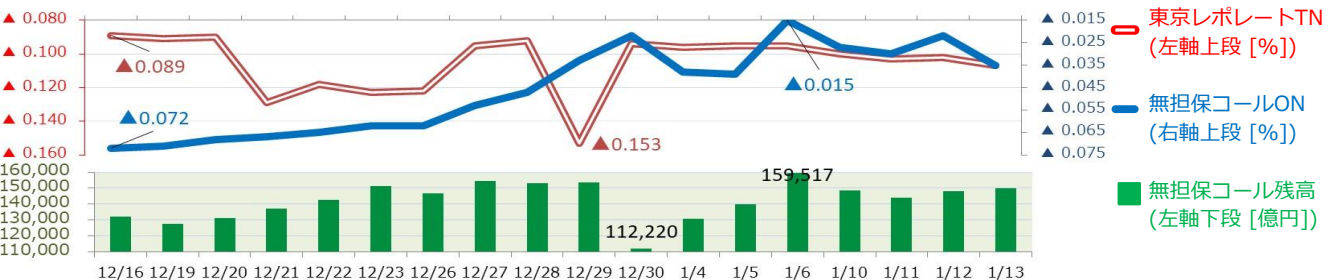
今月の国債買入オペ予定

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