



短期市場の推移

	12月19日	12月20日	12月21日	12月22日
加重平均金利	▲0.010	▲0.010	▲0.011	▲0.010
東京レボレート(TN)	▲0.169	▲0.162	▲0.129	▲0.119
無コール残	169,573	177,945	178,269	186,881
ON	89,411	91,263	87,647	95,159
その他	80,162	86,682	90,622	91,722
有コール残	23,419	23,018	25,360	24,530

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	▲0.011	▲0.094
T/N	-	-	▲0.008	▲0.110
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	-	▲0.253
2W	-	-	-	▲0.232
3W	-	-	-	▲0.196
1M	-	-	-	▲0.184
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.154
6M	-	-	-	▲0.107
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26日の予定 (時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
8:30	完全失業率(11月)		-	
8:30	有効求人倍率(11月)		-	
	-		-	

本日の市況

無担保コールON物は▲0.005%の出合から始まり、その後は主に▲0.018%~▲0.005%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▲0.011%となった。

	都銀・信託	証券	地銀
	- ~ -	- ~ -	▲0.018 ~ ▲0.005

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、出合の水準は本日対比横這い圏を予想する。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	12月25日	12月26日	12月25日	12月26日	12月25日	12月26日
券	▲2,400	▲2,500	▲2,400	▲2,500	▲3,000	▲3,000
財政	+7,500	▲1,000	+7,500	▲1,000	+6,000	+6,000
過不足	+5,100	▲3,500	+5,100	▲3,500	+9,000	+9,000
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				+12,200		
CP等買入	▲400		▲700			
社債等買入	▲100					
国債補充供給	+35,700	▲35,700	+35,700			
当座預金増減	+4,600	+43,700	+4,600	+43,700	▲9,000	▲9,000
当座預金残高	5,453,200	5,496,900	5,453,200	5,496,900	5,487,900	5,487,900
準備預金残高	4,744,100		4,744,100			
積み終了先	4,742,500		4,742,500			
超過準備	4,742,500		4,742,500			
非準備先残高	709,100		709,100			
準備預金進捗率	99.5%		99.5%			
平均	32.3%		32.3%			
乖離率	67.3%		67.3%			

12月25日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
国債買入(12/26~)						
3~5年	4,250	8,075	4,253	▲0.040	▲0.033	71.6
5~10年	4,750	11,025	4,751	▲0.054	▲0.044	74.3
10~25年	1,500	5,856	1,504	▲0.046	▲0.042	50.7
25年~	750	2,546	751	▲0.060	▲0.049	77.0
物価連動	600	2,231	600	▲0.030	▲0.236	56.0
国債補充供給(12/25~12/26)						
	35,990	35,990		▲0.350	▲0.350	
	0	0				

マナタリーベース (億円)
 12月22日時点 6,733,100

所要 (億円)
 今積期の所要準備額 3,969,100
 12月26日以降の残り所要
 積数 19,300
 平均 900

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

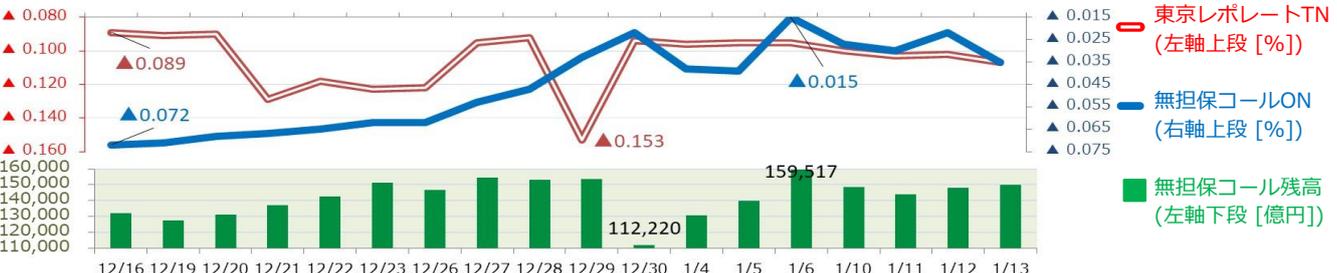
今月の国債買入オペ予定

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	4,250	4 8 18 25	12月25日	0
5年超10年以下	4,500~9,000	4,750	8 13 18 25	12月25日	0
10年超25年以下	1,000~5,000	1,500	4 8 18 25	12月25日	0
25年超	500~3,500	750	4 13 25	12月25日	0
物価連動債	600	600	月1回	12月25日	0
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