



	12月20日	12月21日	12月22日	12月25日
加重平均金利	▲0.010	▲0.011	▲0.010	▲0.011
東京レポレート(TN)	▲0.162	▲0.129	▲0.119	▲0.110
無コール残	177,945	178,269	186,881	175,618
ON	91,263	87,647	95,159	82,646
その他	86,682	90,622	91,722	92,972
有コール残	23,018	25,360	24,530	27,374

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	▲0.011	▲0.103
T/N	▲0.008	▲0.007	▲0.008	▲0.110
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	0.070	▲0.227
2W	▲0.020	0.020	▲0.016	▲0.197
3W	-	-	-	▲0.187
1M	-	-	0.015	▲0.175
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.155
6M	-	-	-	▲0.106
1Y	-	-	-	▲0.066

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

12月27日の予定 (時刻は日本時間)

時間	日本	予想	海外	予想
8:50	12月上旬の貿易収支		-	
8:50	日銀金融政策決定会合における主な意見 (12/18~19)		-	
	-		-	

本日の市況

無担保コールON物は▲0.008%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資金調達ニーズは強く、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比横ばいの▲0.011%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資金調達ニーズは底堅く、出合の水準は本日対比横ばい圏を予想する。

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	12月26日	12月27日	12月27日	12月28日	12月28日	12月29日
券	▲2,400	▲2,100	▲2,100	▲2,000	▲2,000	▲2,000
財政	▲2,000	▲2,600	▲2,600	▲9,000	▲9,000	▲9,000
過不足	▲4,400	▲4,700	▲4,700	▲11,000	▲11,000	▲11,000
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
国庫短期証券買入		+12,200		+1,000		
国債買入						
CP等買入	▲700	▲400	▲400			
国債補完供給	+35,700	▲41,900	+41,900			
当座預金増減		+900	+37,800	▲11,000	▲11,000	▲11,000
当座預金残高		5,454,100	5,491,900	5,480,900	5,480,900	5,480,900
準備預金残高		4,741,800	4,740,400	4,740,400	4,740,400	4,740,400
積み終了先		4,740,400	4,740,400	4,740,400	4,740,400	4,740,400
超過準備		4,740,300	4,740,300	4,740,300	4,740,300	4,740,300
非準備先残高		712,300	712,300	712,300	712,300	712,300
準備預金進捗率		99.5%	99.5%	99.5%	99.5%	99.5%
平均		35.5%	35.5%	35.5%	35.5%	35.5%
乖離率		64.1%	64.1%	64.1%	64.1%	64.1%

12月26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
国庫短期証券買入(12/27~)	1,000	5,604	1,000	0.012	0.020	11.8
米ドル資金供給(12/28~1/11)	0	0	5,580	5,580		
CP等買入(12/29~)	4,000	7,600	3,990	0.005	0.023	92.6
国債補完供給(12/26~12/27)	42,135	42,135	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マネタリーベース [億円]	所要 [億円]
12月25日時点 6,740,100	今積期の所要準備額 3,969,100
	12月27日以降の残り所要積数 17,900
	平均 900

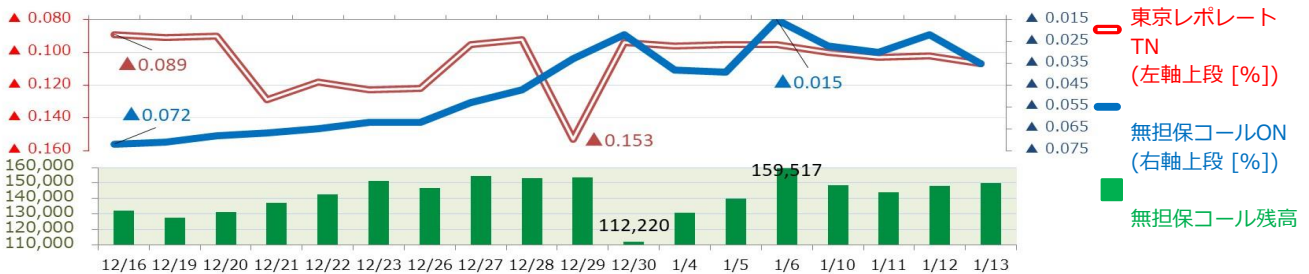
1月5日	3ヶ月
1月9日	6ヶ月
1月12日	3ヶ月
1月18日	1年

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