



短期市場の推移

	12月21日	12月22日	12月25日	12月26日
加重平均金利	▲0.011	▲0.010	▲0.011	▲0.011
東京レボレート(TN)	▲0.129	▲0.119	▲0.110	▲0.110
無コール残	178,269	186,881	175,618	179,081
ON	87,647	95,159	82,646	86,104
その他	90,622	91,722	92,972	92,977
有コール残	25,360	24,530	27,374	25,890

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	▲0.080	0.001	▲0.013	▲0.097
T/N	▲0.011	0.001	▲0.008	▲0.109
S/N	-	-	-	-
1W	0.008	0.015	0.010	▲0.219
2W	-	-	-	▲0.191
3W	-	-	-	▲0.179
1M	0.180	0.350	0.293	▲0.166
2M	-	-	-	-
3M	-	-	0.026	▲0.153
6M	-	-	-	▲0.108
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28日の予定 (時刻は日本時間)

時刻	日本	予想	海外	予想
8:50	11月の鉱工業生産速報		-	
	-		-	
	-		-	

本日の市況

無担保コールON物は▲0.008%の合出から始まり、その後は主に▲0.020%~▲0.006%を中心に取引された。ビッドサイドの調達意欲が減退しており、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比0.002%低下の▲0.013%となった。

[%]		
都銀・信託	証券	地銀
- ~ -	- ~ -	▲0.025 ~ ▲0.006

翌営業日のマーケット

ビッドサイドの調達意欲に減退傾向がみられ、出合の水準は本日対比低下すると予想。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	12月27日	12月28日	12月27日	12月28日	12月29日	12月30日
券	▲2,000	▲2,700	▲2,000	▲2,700	▲1,000	▲1,000
財政	▲200	▲3,800	▲200	▲3,800	▲6,700	▲6,700
過不足	▲2,200	▲6,500	▲2,200	▲6,500	▲7,700	▲7,700
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		+1,000				
CP等買入	▲400	▲1,500	▲400	▲1,500	+4,000	+4,000
国債補完供給	+41,900	▲44,700	+41,900	+44,700		
当座預金増減	▲4,400	+36,700	▲4,400	+36,700	▲3,700	▲3,700
当座預金残高	5,449,700	5,486,400	5,449,700	5,486,400	5,482,700	5,482,700
準備預金残高	4,733,800		4,733,800			
積み終了先	4,732,300		4,732,300			
超過準備	4,732,300		4,732,300			
非準備先残高	715,900		715,900			
準備預金進捗率	99.6%		99.6%			
平均	38.7%		38.7%			
乖離率	60.9%		60.9%			

12月27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(12/27~12/28)	45,134	45,134	▲0.350	▲0.351		
	0	0				

マナタリーベース [億円]
 12月26日時点 6,743,400

所要	[億円]
今積期の所要準備額	3,969,100
12月28日以降の残り所要	
積数	16,400
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
1月10日	10年
1月12日	30年
1月16日	5年
1月18日	20年

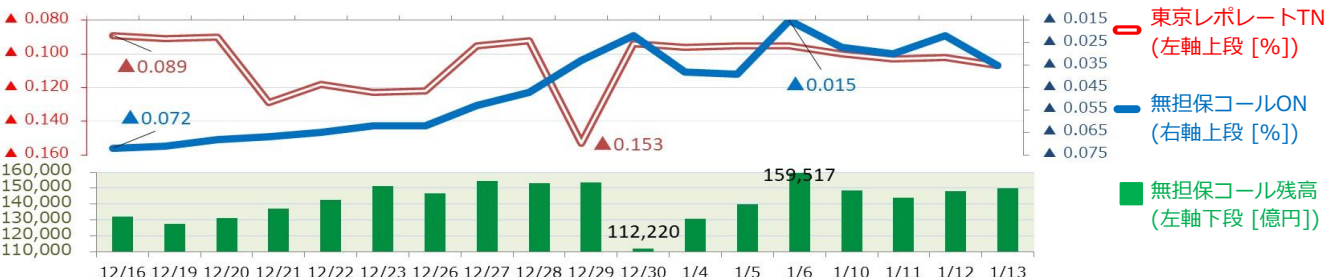
今月の国債買入オペ予定

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