



### 短期市場の推移

	12月22日	12月25日	12月26日	12月27日
加重平均金利	▲0.010	▲0.011	▲0.011	▲0.013
東京レボレート(TN)	▲0.119	▲0.110	▲0.110	▲0.109
無コール残	186,881	175,618	179,081	179,163
ON	95,159	82,646	86,104	86,026
その他	91,722	92,972	92,977	93,137
有コール残	24,530	27,374	25,890	26,739

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	▲0.016	▲0.096
T/N	▲0.035	0.001	▲0.025	▲0.129
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.030	▲0.025	▲0.029	▲0.167
2W	-	-	-	▲0.157
3W	-	-	-	▲0.159
1M	▲0.008	0.001	▲0.003	▲0.157
2M	-	-	-	-
3M	0.035	0.040	0.036	▲0.150
6M	-	-	-	▲0.102
1Y	-	-	-	▲0.065

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29日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	-	-
-	-	-	-
-	-	-	-

### 本日の市況

無担保コールON物は▲0.009%の出合から始まり、その後は主に▲0.020%~▲0.009%を中心に取引された。昨日に引き続き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0.003%低下の▲0.016%となった。

都銀・信託	証券	地銀
- ~ -	- ~ -	▲0.025 ~ ▲0.005

### 翌営業日のマーケット

四半期末のため一部ビッドサイドが調達を控えることから、出合水準は本日対比低下を想定。

### 資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想
	12月28日	12月29日	12月28日	12月29日	1月4日
券	▲2,700	+100	▲2,700	+100	+3,000
財政	▲3,300	▲7,300	▲3,300	▲7,300	▲20,000
過不足	▲6,000	▲7,200	▲6,000	▲7,200	▲17,000
金融調節	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド
CP等買入	▲1,500	▲2,900	▲1,500	▲2,900	+4,000
国債補完供給	+44,700	▲46,000	+44,700	+46,000	-
当座預金増減	▲8,800	+39,900	▲8,800	+39,900	▲17,000
当座預金残高	5,440,900	5,480,800	5,440,900	5,480,800	5,463,800
準備預金残高	4,707,600	4,706,000	4,707,600	4,706,000	4,706,000
積み終了先	4,706,000	4,706,000	4,706,000	4,706,000	4,706,000
超過準備	4,706,000	4,706,000	4,706,000	4,706,000	4,706,000
非準備先残高	733,300	733,300	733,300	733,300	733,300
準備預金進捗率	99.6%	99.6%	99.6%	99.6%	99.6%
平均	41.9%	41.9%	41.9%	41.9%	41.9%
乖離率	57.7%	57.7%	57.7%	57.7%	57.7%

### 12月28日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
国債補完供給(12/28~12/29)	46,219	46,219	▲0.350	▲0.351	-	-
	0	0	-	-	-	-

マナタリーベース (億円)  
12月27日時点 6,741,000

所要	(億円)
今積期の所要準備額	3,969,100
12月29日以降の残り所要	-
積数	14,800
平均	800

### 国庫短期証券入札予定

1月5日	3ヶ月(第1204回)
1月9日	6ヶ月(第1205回)
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

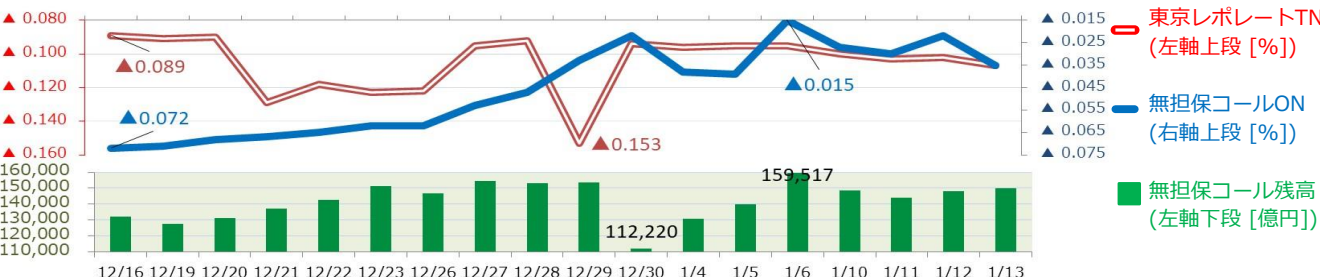
### 今月の国債買入オペ予定

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