



短期市場の推移 [億円] [%]

	12月26日	12月27日	12月28日	12月29日
加重平均金利	▲0.011	▲0.013	▲0.016	▲0.039
東京レポレート(TN)	▲0.110	▲0.109	▲0.129	▲0.108
無コール残	179,081	179,163	174,810	115,456
ON	86,104	86,026	83,923	66,708
その他	92,977	93,137	90,887	48,748
有コール残	25,890	26,739	27,458	24,172

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	▲0.085	0.001	▲0.021	▲0.088
T/N	-	-	▲0.018	▲0.105
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.040	0.020	▲0.029	▲0.120
2W	▲0.028	0.200	▲0.010	▲0.127
3W	-	-	-	▲0.134
1M	▲0.013	0.480	0.033	▲0.134
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.141
6M	-	-	-	▲0.097
1Y	-	-	-	▲0.060

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

1月5日の予定 (時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
8:50	マネタリーベース (12月)		(米) 12月の雇用統計	
15:00	財政資金対民間収支の実績 (12月)		(欧) ユーロ圏 12月の消費者物価 (速報)	

本日の市況

無担保コールON物は▲0.020%の出合から始まり、その後は主に▲0.030%~▲0.013%を中心に取引された。四半期末に調達を控えていた先を中心に調達意欲が強まり、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.018%の▲0.021%となった。

都銀・信託	証券	地銀
- ~ -	▲0.020 ~ ▲0.020	▲0.030 ~ ▲0.013

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意欲は底堅く、出合の水準は本日対比横ばい圏を想定。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	1月4日		1月5日		1月9日	
券		+2,300		+3,000		+3,000
財政		+2,200		▲2,800		▲66,000
過不足		+4,500		+200		▲63,000
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
国債補完供給	+41,800	▲44,600	+44,600			
当座預金増減		+1,700		+44,800		▲63,000
当座預金残高		5,438,500		5,483,300		5,420,300
準備預金残高		4,722,000				
積み終了先		4,721,200				
超過準備		4,721,200				
非準備先残高		716,500				
準備預金進捗率		99.9%				
平均		64.5%				
乖離率		35.4%				

1月4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(1/4~1/5)	44,841	44,841	▲0.350	▲0.351		
	0	0				

マネタリーベース [億円]

12月29日時点 6,730,500

所要

今積期の所要準備額	3,969,100
1月5日以降の残り所要	
積数	1,900
平均	200

国債短期証券入札予定

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

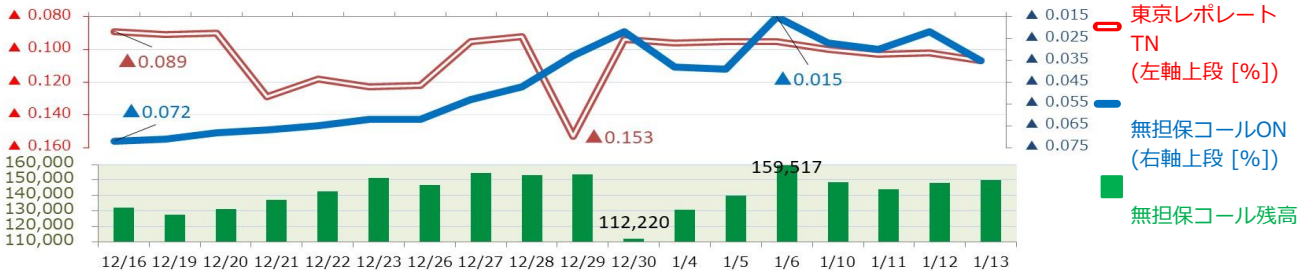
今月の国債買入オペ予定

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	1
1年超3年以下	3,000~6,500	3,750	9 15 19 24	12月18日	4
3年超5年以下	3,500~7,500	4,250	9 19 24 29	12月25日	4
5年超10年以下	4,000~9,000	4,750	15 19 24 29	12月25日	4
10年超25年以下	1,000~5,000	1,500	9 15 24	12月25日	3
25年超	500~3,500	750	19 29	12月25日	2
物価連動債	600	600	月1回	12月25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