



短期市場の推移

	12月27日	12月28日	12月29日	1月4日
加重平均金利	▲0.013	▲0.016	▲0.039	▲0.021
東京レボレート(TN)	▲0.109	▲0.129	▲0.108	▲0.105
無コール残	179,163	174,810	115,456	142,284
ON	86,026	83,923	66,708	73,846
その他	93,137	90,887	48,748	68,438
有コール残	26,739	27,458	24,172	26,850

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	▲0.087	0.001	▲0.018	▲0.087
T/N	-	-	▲0.013	▲0.096
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.030	▲0.002	▲0.025	▲0.116
2W	▲0.028	▲0.003	▲0.023	▲0.124
3W	-	-	-	▲0.129
1M	▲0.015	▲0.002	▲0.011	▲0.133
2M	-	-	-	-
3M	-	-	0.020	▲0.139
6M	-	-	-	▲0.097
1Y	-	-	-	▲0.061

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

1月9日の予定 (時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
8:30	東京都都区消費者物価 (12月中旬)		(米) 11月の貿易収支	
	-		-	
	-		-	

本日の市況

無担保コールON物は▲0.013%の合出から始まり、その後は主に▲0.008%~▲0.040%を中心に取引された。積み期終盤かつ週末要因により調達意欲は底堅く、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.003%の▲0.018%となった。

	都銀・信託	証券	地銀
	- ~ -	▲0.025 ~ ▲0.025	▲0.04 ~ ▲0.008

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	
	1月5日	1月9日	1月9日	1月10日	1月10日	1月10日
券	+3,200	+3,100	+3,100	+3,000	+3,000	+3,000
財政	+2,400	▲38,500	▲38,500	+1,000	+1,000	+1,000
過不足	+5,600	▲35,400	▲35,400	+4,000	+4,000	+4,000
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
共通担保(全店)						▲12,600
国債補充供給	+44,600	▲43,300	+43,300			
当座預金増減	+6,900	+7,900	+7,900	▲8,600	▲8,600	▲8,600
当座預金残高	5,445,400	5,453,300	5,453,300	5,444,700	5,444,700	5,444,700
準備預金残高	4,735,900					
積み終了先	4,735,700					
超過準備	4,735,600					
非準備先残高	709,500					
準備預金進捗率	99.9%					
平均	77.4%					
乖離率	22.5%					

1月5日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
国債補充供給(1/5~1/9)	43,580	43,580	▲0.350	▲0.351		
	0	0				

マネタリーベース (億円)
1月4日時点 6,729,900

所要	(億円)
今積期の所要準備額	3,969,100
1月9日以降の残り所要	
積数	600
平均	100

国庫短期証券入札予定

1月9日	6ヶ月(第1205回)
1月12日	3ヶ月(第1206回)
1月18日	1年
1月19日	3ヶ月

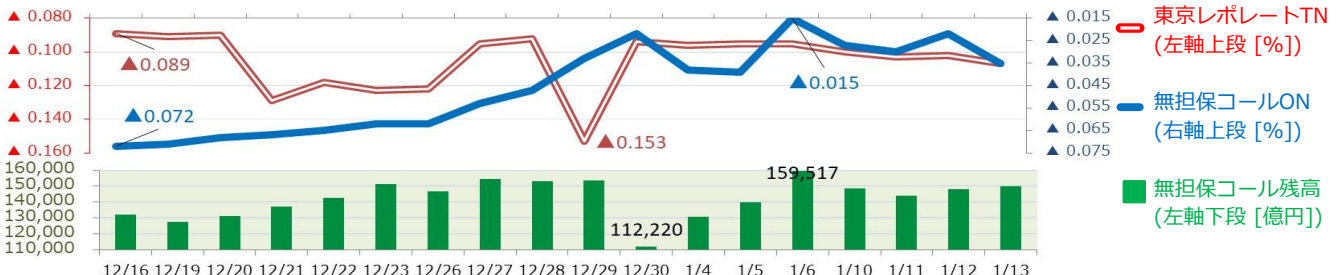
今月の国債買入オペ予定

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