



短期市場の推移

[億円] [%]

	11月25日	11月26日	11月29日	11月30日
加重平均金利	▲0.042	▲0.043	▲0.047	▲0.048
東京レポレート(TN)	▲0.101	▲0.100	▲0.100	▲0.096
無コール残	167,592	175,741	167,841	165,990
ON	86,489	94,163	87,183	87,502
その他	81,103	81,578	80,658	78,488
有コール残	17,273	17,370	19,177	17,622

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	▲0.050	▲0.091
T/N	-	-	▲0.010	▲0.095
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.055	▲0.028	▲0.039	▲0.097
2W	▲0.040	0.045	▲0.021	▲0.099
3W	-	-	-	▲0.103
1M	-	-	-	▲0.115
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.119
6M	-	-	-	▲0.127
1Y	-	-	-	▲0.136

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

資金需給

[億円]

	日銀速報	日銀予想	当社需給予想
	12月1日	12月2日	12月3日
券	▲1,200	▲1,500	▲1,000
財政	▲40,400	▲68,400	▲26,000
過不足	▲41,600	▲69,900	▲27,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国庫短期証券買入	+1,000		
CP等買入	▲100	▲100	
国債補完供給	+300	+700	
成長基盤強化支援	▲4,300	+2,500	
当座預金増減	▲42,900	▲69,300	▲27,000
当座預金残高	5,334,500	5,265,200	5,238,200
準備預金残高	4,691,700	主な需給要因	
積み終了先	4,691,300	税・保険揚げ	
超過準備	4,691,300	国債発行(10年)	
非準備先残高	642,800		
準備預金進捗率	99.9%		
平均	53.3%		
乖離率	46.6%		

12月1日のオペ結果

[%][億円]※ミ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(12/1~12/2)	650	650	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マネタリーベース [億円]

11月30日時点 6,604,500

所要

今積期の所要準備額 3,633,000

12月2日以降の残り所要

積数 400

平均 0

国庫短期証券入札予定

12月3日	3ヶ月(第1042回)
12月9日	6ヶ月
12月10日	3ヶ月
12月14日	6ヶ月

国債入札予定

12月2日	10年
12月7日	30年
12月9日	5年
12月16日	20年

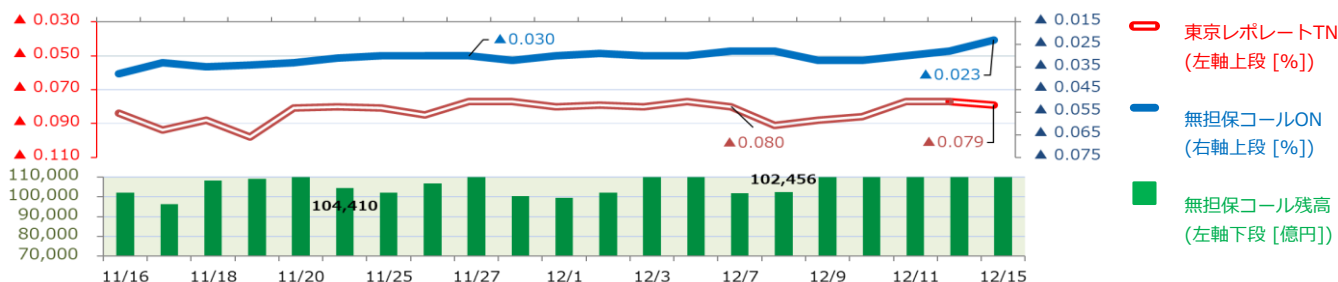
今月の国債買入オペ予定

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	11月24日	1
1年超3年以下	4500	4,500	3 8 15 21	11月24日	4
3年超5年以下	4500	4,500	3 15 21 24	11月29日	4
5年超10年以下	4250	4,250	8 15 21 24	11月29日	4
10年超25年以下	1500	1,500	3 15	11月2日	1
25年超	500	500	15	11月17日	1
物価連動債	600	600	月1回	11月29日	1
変動利付債<四半期>	300	300	四半期に1回	10月13日	0

1年前の市場推移

○2020年11月積み期 [11月16日~12月15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