



短期市場の推移

	11月26日	11月29日	11月30日	12月1日
加重平均金利	▲0.043	▲0.047	▲0.048	▲0.050
東京レボレート(TN)	▲0.100	▲0.100	▲0.096	▲0.095
無コール残	175,741	167,841	165,990	158,139
ON	94,163	87,183	87,502	81,751
その他	81,578	80,658	78,488	76,388
有コール残	17,370	19,177	17,622	18,610

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	▲0.050	▲0.090
T/N	▲0.020	▲0.010	▲0.013	▲0.092
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.030	▲0.020	▲0.026	▲0.094
2W	▲0.040	▲0.001	▲0.028	▲0.098
3W	-	-	0.000	▲0.102
1M	-	-	0.150	▲0.114
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.118
6M	-	-	-	▲0.127
1Y	-	-	-	▲0.136

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3日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	米	11月の雇用統計
-	-	-	-
-	-	-	-

経済指標及び予想値は株式会社フィスコ提供

本日の市況

本日の無担保コールON物は▲0.050%の出会いから始まり、その後は主に▲0.050%~▲0.025%の水準で出会いが見られた。引き続きビッドサイドの調達意欲はあまり強くなく、本日の同加重平均金利(速報)は前営業日対比横ばいの▲0.050%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.085 ~ ▲0.085	▲0.065 ~ ▲0.065	▲0.050 ~ ▲0.025

翌営業日のマーケット

一部運用ニーズの減退が見込まれ、出会いの水準は本日対比若干の上昇と予想。

資金需給

	日銀速報	日銀予想	当社需給予想
	12月2日	12月3日	12月6日
券	▲1,600	▲1,100	+0
財政	▲68,100	▲25,500	+7,000
過不足	▲69,700	▲26,600	+7,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
CP等買入	▲100	▲700	
社債等買入		▲100	
国債補完供給	+700	+100	
当座預金増減	▲69,200	▲27,300	+7,000
当座預金残高	5,265,300	5,238,000	5,245,000
準備預金残高	4,626,500	主な需給要因	
積み終了先	4,626,500	国債発行(10年)	国庫短期証券発行償還
超過準備	4,626,200		(3M)
非準備先残高	638,800		
準備預金進捗率	99.9%		
平均	56.7%		
乖離率	43.2%		

12月2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(12/2~12/3)	100	100	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マネタリーベース (億円)
12月1日時点 6,562,800

所要	(億円)
今積期の所要準備額	3,633,000
12月3日以降の残り所要	
積数	200
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(第1043回)
12月10日	3ヶ月
12月14日	6ヶ月
12月7日	30年
12月9日	5年
12月16日	20年
12月27日	2年

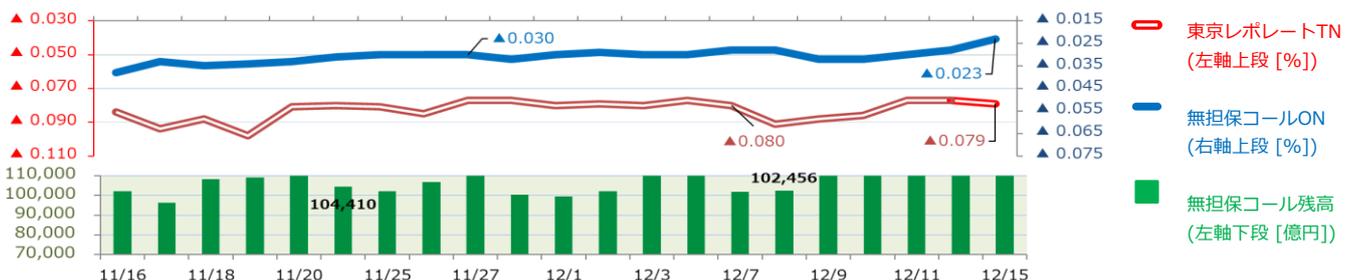
今月の国債買入オペ予定

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	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