



短期市場の推移

	11月29日	11月30日	12月1日	12月2日
加重平均金利	▲0.047	▲0.048	▲0.050	▲0.050
東京レボレート(TN)	▲0.100	▲0.096	▲0.095	▲0.092
無コール残	167,841	165,990	158,139	158,192
ON	87,183	87,502	81,751	80,524
その他	80,658	78,488	76,388	77,668
有コール残	19,177	17,622	18,610	18,465

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。

12月6日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
		ユーロ圏財務相会合	

経済指標及び予想値は株式会社フィスコ提供

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	▲0.085	0.001	▲0.043	▲0.087
T/N	-	-	▲0.010	▲0.085
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.053	▲0.003	▲0.039	▲0.090
2W	-	-	-	▲0.094
3W	-	-	-	▲0.098
1M	-	-	-	▲0.112
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

本日の市況

本日の無担保コールON物は▲0.04%の出合から始まり、その後は主に▲0.050%~▲0.025%のレンジで推移した。週末要因により昨日対比資金調達サイドのニーズが強くなり、本日の同加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.007%の▲0.043%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.085 ~ ▲0.085	▲0.060 ~ ▲0.060	▲0.050 ~ ▲0.025

翌営業日のマーケット

資金調達サイドのニーズは強くなると見込まれ、出合水準は本日対比上昇と予想。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想
	12月3日	12月6日	12月6日	12月7日	12月7日
券	▲1,100	▲300	▲300	▲1,000	▲1,000
財政	▲26,300	+11,400	+11,400	+0	+0
過不足	▲27,400	+11,100	+11,100	▲1,000	▲1,000
金融調節	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド
国債買入			+10,700		
CP等買入	▲700		▲100		
社債等買入	▲100		▲300		
国債補充供給	+100	▲100	+100		
当座預金増減	▲28,200	+21,500	+21,500	▲1,000	▲1,000
当座預金残高	5,237,100	5,258,600	5,258,600	5,257,600	5,257,600
準備預金残高	4,625,200	4,625,200	4,625,200	4,625,200	4,625,200
積み終了先	4,625,200	4,625,200	4,625,200	4,625,200	4,625,200
超過準備	4,625,200	4,625,200	4,625,200	4,625,200	4,625,200
非準備先残高	611,900	611,900	611,900	611,900	611,900
準備預金進捗率	99.9%	99.9%	99.9%	99.9%	99.9%
平均	66.7%	66.7%	66.7%	66.7%	66.7%
乖離率	33.2%	33.2%	33.2%	33.2%	33.2%

12月3日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
国債買入(12/6~)						
1~3年	4,500	15,135	4,504	0.003	0.003	89.5
3~5年	4,500	12,438	4,506	▲0.004	▲0.003	26.5
10~25年	1,500	4,942	1,512	▲0.003	▲0.002	54.4
国債補充供給(12/3~12/6)						
	82	82	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マネタリーベース (億円)
12月2日時点 6,495,200

所要	(億円)
今積期の所要準備額	3,633,000
12月6日以降の残り所要	
積数	100
平均	0

国庫短期証券入札予定

12月9日	6ヶ月(第1043回)
12月10日	3ヶ月(第1044回)
12月14日	6ヶ月
12月15日	1年
12月7日	30年
12月9日	5年
12月16日	20年
12月27日	2年

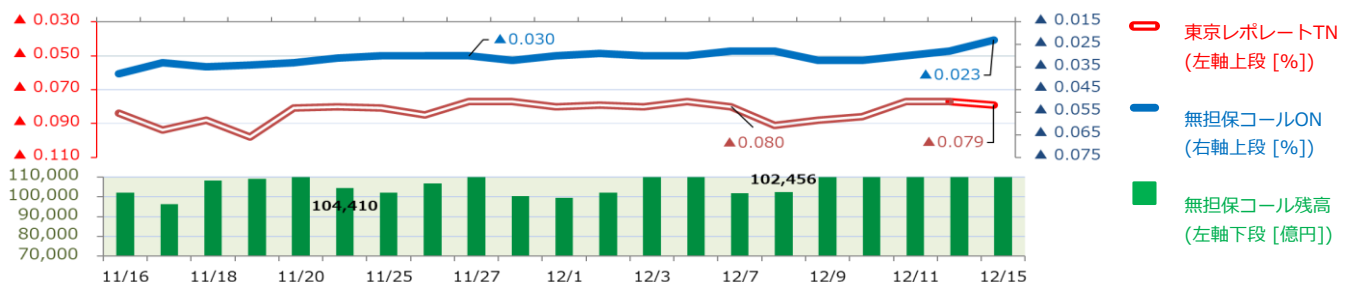
今月の国債買入オペ予定

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	12月3日	3
3年超5年以下	4500	4,500	3 15 21 24	12月3日	3
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	12月3日	0
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