



短期市場の推移

	11月30日	12月1日	12月2日	12月3日
加重平均金利	▲0.048	▲0.050	▲0.050	▲0.043
東京レポレート(TN)	▲0.096	▲0.095	▲0.092	▲0.085
無コール残	165,990	158,139	158,192	152,830
ON	87,502	81,751	80,524	72,872
その他	78,488	76,388	77,668	79,958
有コール残	17,622	18,610	18,465	18,711

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	▲0.080	0.001	▲0.035	▲0.084
T/N	▲0.025	▲0.010	▲0.020	▲0.084
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.050	0.000	▲0.033	▲0.087
2W	-	-	-	▲0.093
3W	-	-	-	▲0.096
1M	-	-	-	▲0.111
2M	-	-	0.015	-
3M	-	-	-	▲0.117
6M	-	-	-	▲0.126
1Y	-	-	-	▲0.135

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

12月7日の予定 (時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
11月のコール市場残高(日銀)			22:30	(米)10月貿易収支	-667億米ドル
-				-	
-				-	

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▲0.02%の出合から始まり、その後は主に▲0.050%~▲0.02%のレンジで推移した。地銀を中心に積極的に調達に動く先も見られ、本日の同加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.008%の▲0.035%となった。

都銀・信託	証券	地銀
- ~ -	▲0.035 ~ ▲0.035	▲0.050 ~ ▲0.020

翌営業日のマーケット

ビッドサイドのニーズは引き続き強く、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6日	12月7日	12月7日	12月8日	12月8日	12月8日
券	▲200	▲1,100	▲1,100	▲1,100	+0	+0
財政	+13,000	+2,800	+2,800	+2,800	+9,000	+9,000
過不足	+12,800	+1,700	+1,700	+1,700	+9,000	+9,000
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
国債買入		+10,700				
共通担保(全店)					▲2,600	
CP等買入	▲100		▲100			
社債等買入	▲300					
国債補充供給	+100	▲500	+500			
当座預金増減	+22,700	+2,100	+2,100	+2,100	▲11,600	▲11,600
当座預金残高	5,259,800	5,261,900	5,261,900	5,261,900	5,250,300	5,250,300
準備預金残高	4,661,500					
積み終了先	4,661,400					
超過準備	4,661,400					
非準備先残高	598,300					
準備預金進捗率	99.9%					
平均	70.0%					
乖離率	29.9%					

12月6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(12/6~12/7)	463	463	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マネタリーベース (億円)
12月3日時点 6,468,100

所要	(億円)
今積期の所要準備額	3,633,000
12月7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

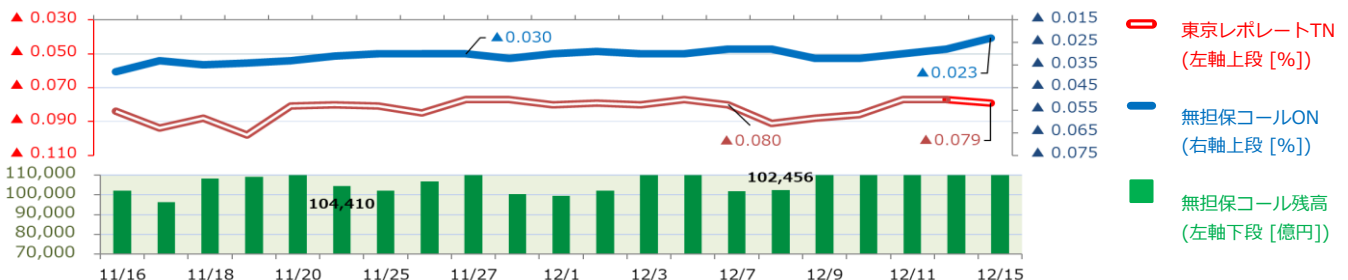
今月の国債買入オペ予定

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 15	12月3日	0
25年超	500	500		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