



短期市場の推移

	11月25日	11月28日	11月29日	11月30日
加重平均金利	▲0.075	▲0.077	▲0.078	▲0.079
東京レポレート(TN)	▲0.102	▲0.131	▲0.121	▲0.128
無コール残	137,926	132,910	129,595	127,406
ON	70,594	65,698	62,393	64,954
その他	67,332	67,212	67,202	62,452
有コール残	31,756	30,403	29,350	28,323

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	▲0.079	▲0.104
T/N	-	-	-	▲0.119
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	-	▲0.124
2W	▲0.075	0.180	▲0.037	▲0.125
3W	-	-	▲0.001	▲0.132
1M	-	-	-	▲0.154
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.139
6M	-	-	-	▲0.131
1Y	-	-	-	▲0.129

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2日の予定 (時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
8:50	11月マナタリーベース (日銀)		19:00	(欧)10月生産者物価指数 [前年比]	-
15:00	11月財政資金対民間収支の実績 (財務省)		22:30	(米)11月非農業部門雇用者数	20.0万人
	-		22:30	(米)11月失業率	3.7%

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▲0.080%の出合から始まり、その後は主に▲0.087%~▲0.078%の水準で取引された。前営業日と調達サイドの動向は変わらずON物加重平均金利(速報)は前営業日と横ばいの▲0.079%となった。

都銀・信託	証券	地銀
-	-	▲0.087 ~ ▲0.078

翌営業日のマーケット

調達ニーズは本日と同様に限定的で、出合の水準は本日対比横ばいと予想する。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	12月1日	12月2日	12月1日	12月2日	12月1日	12月2日
券	▲1,000	▲600		▲1,000		+1,000
財政	▲53,700	▲105,700		▲4,000		▲4,000
過不足	▲54,700	▲106,300		▲3,000		▲3,000
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		+1,400		+15,400		
CP等買入	▲100		▲100			
社債等買入			▲100			
国債補完供給	+8,400	▲8,600	+8,600			
成長基盤強化支援			▲3,100			
当座預金増減	▲53,600	▲85,600	▲3,000			
当座預金残高	4,887,500	4,801,900	4,798,900			
準備預金残高	4,232,100	主な需給要因				
積み終了先	4,231,600		税保険揚げ・国債発行(10年)		国庫短期証券発行・償還(3M)	
超過準備	4,231,300					
非準備先残高	655,400					
準備預金進捗率	99.9%					
平均	53.3%					
乖離率	46.5%					

12月1日のオペ結果

【%】(億円)※米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
国債買入(固定利回り方式)(12/2~)						
5~10年	15,465	15,465				
5~10年	0	0				
5~10年	0	0				
国債補完供給(12/1~12/2)						
8,575	8,575	▲0.350	▲0.351			
29	29	▲0.350	▲0.350			

マナタリーベース (億円)
11月30日時点 6,199,200

所要 (億円)
今積期の所要準備額 3,767,900
12月2日以降の残り所要
積数 4,600
平均 300

国庫短期証券入札予定

12月2日	3ヶ月(第1124回)
12月8日	6ヶ月(第1125回)
12月9日	3ヶ月
12月16日	3ヶ月
12月6日	30年
12月8日	5年
12月15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2日	1
1年超3年以下	4750	4,750	2 7 14 19	11月21日	4
3年超5年以下	4750	4,750	2 14 19 26	11月28日	4
5年超10年以下	5500	5,500	7 14 19 26	11月28日	4
10年超25年以下	2500	2,500	7 19 26	11月28日	3
25年超	1000	1,000	2 14 26	11月28日	3
物価連動債	600	600	月1回	11月14日	1
変動利付債<四半期>	300	300	四半期に1回	10月17日	0

1年前の市場推移

○2021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