



### 短期市場の推移

	11月28日	11月29日	11月30日	12月1日
加重平均金利	▲0.077	▲0.078	▲0.079	▲0.079
東京レポレート(TN)	▲0.131	▲0.121	▲0.128	▲0.119
無コール残	132,910	129,595	127,406	128,300
ON	65,698	62,393	64,954	61,488
その他	67,212	67,202	62,452	66,812
有コール残	30,403	29,350	28,323	30,434

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	▲0.078	▲0.103
T/N	-	-	-	▲0.114
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	▲0.075	▲0.123
2W	-	-	▲0.075	▲0.125
3W	-	-	-	▲0.129
1M	-	-	-	▲0.153
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.140
6M	-	-	-	▲0.132
1Y	-	-	-	▲0.128

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5日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	19:00 (欧)10月小売売上高[前月比]	-
-	-	-	-
-	-	-	-

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%の合出から始まり、その後は主に▲0.087%~▲0.078%の水準で取引された。3日積みではあったものの前営業日から調達サイドの動向に変化はなく、ON物加重平均金利(速報)は前営業日+0.001の▲0.078%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

オファーサイド・ビッドサイドともに大きな動向変化はなく、合出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2日		12月5日		12月6日	
券	▲600		▲1,100		▲1,000	
財政	▲104,200		▲900		+0	
過不足	▲104,800		▲2,000		▲1,000	
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	+15,400		+13,100		-	
CP等買入	▲100		▲700		-	
社債等買入	▲100		▲300		-	
国債補完供給	+8,600		+9,100		-	
成長基盤強化支援	▲3,100		-		-	
当座預金増減	▲93,200		+19,200		▲1,000	
当座預金残高	4,794,300		4,813,500		4,812,500	
準備預金残高	4,149,000		-		-	
積み終了先	4,148,600		-		-	
超過準備	4,148,600		-		-	
非準備先残高	645,300		-		-	
準備預金進捗率	99.9%		-		-	
平均	63.3%		-		-	
乖離率	36.6%		-		-	

### 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
国債買入(固定利回り方式)(12/5~)	-					
5~10年	1,127	1,127	-	-	-	-
5~10年	0	0	-	-	-	-
5~10年	0	0	-	-	-	-
国債買入(12/5~)	-					
~1年	1,500	4,651	1,500	0.025	0.027	99.9
1~3年	4,750	11,203	4,761	0.002	0.003	87.9
3~5年	4,750	7,911	4,755	▲0.004	▲0.003	44.1
25年~	1,000	1,535	1,001	▲0.010	▲0.007	55.4
国債補完供給(12/2~12/5)	-					
	9,092	9,092	▲0.350	▲0.350	-	-
	0	0	-	-	-	-

マネタリーベース	【億円】
12月1日時点	6,146,600

所要	【億円】
今積期の所要準備額	3,767,900
12月5日以降の残り所要	-
積数	3,300
平均	300

### 国庫短期証券入札予定

12月8日	6ヶ月(第1125回)
12月9日	3ヶ月(第1126回)
12月16日	3ヶ月
12月19日	1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	12月2日	0
1年超3年以下	4750	4,750	2 7 14 19	12月2日	3
3年超5年以下	4750	4,750	2 14 19 26	12月2日	3
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	12月2日	2
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	-

### 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