



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	▲0.078	▲0.079	▲0.079	▲0.078
東京レポレート(TN)	▲0.121	▲0.128	▲0.119	▲0.114
無コール残	129,595	127,406	128,300	124,439
ON	62,393	64,954	61,488	57,627
その他	67,202	62,452	66,812	66,812
有コール残	29,350	28,323	30,434	31,128

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	▲0.102
T/N	-	-	-	▲0.107
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.078	▲0.070	▲0.077	▲0.117
2W	-	-	-	▲0.123
3W	-	-	0.050	▲0.127
1M	-	-	-	▲0.153
2M	-	-	-	-
3M	-	-	0.220	▲0.139
6M	-	-	-	▲0.131
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6日の予定 (時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
	-		-	
	-		-	
	-		-	

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▲0.078%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。一部地銀において調達ニーズの強まりも見られたが、地合いに大きな変化はなくON物加重平均金利(速報)は前営業日横ばいの▲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、ビッドサイド共に大きな動きは見られないため、出合水準は本日対比横ばいを想定する。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	12月5日		12月6日		12月7日	
券	▲1,100		▲400		▲1,000	
財政	+1,400		+700		▲3,000	
過不足	+300		+300		▲4,000	
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		+13,100		+700		
共通担保(全店)					▲1,500	
CP等買入	▲700					
社債等買入	▲300					
国債補充供給	+9,100	▲9,600	+9,600			
当座預金増減	+11,900		+10,600		▲5,500	
当座預金残高	4,806,200		4,816,800		4,811,300	
準備預金残高	4,174,900		主な需給要因			
積み終了先	4,174,600		国債発行(30年)			
超過準備	4,174,400					
非準備先残高	631,300					
準備預金進捗率	99.9%					
平均	66.7%					
乖離率	33.2%					

12月5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)(12/6~)						
5~10年	723	723				
5~10年	0	0				
5~10年	0	0				
国債補充供給(12/5~12/6)						
	9,555	9,555	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マネタリーベース (億円)
12月2日時点 6,054,000

所要 (億円)
今積期の所要準備額 3,767,900
12月6日以降の残り所要
積数 2,800
平均 300

国債短期証券入札予定

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

国債入札予定

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	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