



短期市場の推移

	11月30日	12月1日	12月2日	12月5日
加重平均金利	▲0.079	▲0.079	▲0.078	▲0.078
東京レボレート(TN)	▲0.128	▲0.119	▲0.114	▲0.107
無コール残	127,406	128,300	124,439	130,919
ON	64,954	61,488	57,627	64,797
その他	62,452	66,812	66,812	66,122
有コール残	28,323	30,434	31,128	31,857

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)			レボ市場
	最低	最高	平均	東京レボレート
O/N	▲0.087	0.001	▲0.078	▲0.099
T/N	-	-	-	▲0.101
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.075	▲0.069	▲0.074	▲0.114
2W	-	-	-	▲0.120
3W	-	-	0.050	▲0.126
1M	-	-	-	▲0.152
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.139
6M	-	-	-	▲0.131
1Y	-	-	-	▲0.128

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

12月7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。新たに資金調達に動く先が出てきたが、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	-	▲0.087	▲0.087	~ ▲0.076

翌営業日のマーケット

動向に大きな変化はなく、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6日		12月7日		12月8日	
券	▲500		▲1,300		▲1,000	
財政	+1,000		▲9,200		+5,000	
過不足	+500		▲10,500		+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
国庫短期証券買入				+1,000		
国債買入		+700		+1,000		
共通担保(全店)			▲1,500	+1,500		
CP等買入			▲200			
社債等買入			▲200			
国債補充供給	+9,600	▲12,300	+12,300			
当座預金増減	▲1,500		+3,400		+4,000	
当座預金残高	4,804,700		4,808,100		4,812,100	
準備預金残高	4,176,200		主な需給要因			
積み終了先	4,175,900		国債発行(30年)			
超過準備	4,175,900					
非準備先残高	628,500					
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
国庫短期証券買入(12/7~)	1,000	6,396	1,000	0.021	0.021	
国債買入(固定利回り方式)(12/7~)						
5~10年	990	990				
5~10年	0	0				
5~10年	0	0				
米ドル資金供給(12/8~12/15)	1	1	4,090	4,090		
国債補充供給(12/6~12/7)	12,219	12,219	▲0.350	▲0.350		
	0	0				
共通担保(全店)(12/7~12/20)	1,451	1,451				

マネタリーベース 【億円】
 12月5日時点 6,066,900

所要	【億円】
今積期の所要準備額	3,767,900
12月7日以降の残り所要	
積数	2,500
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
12月8日	5年
12月15日	20年
12月27日	2年
1月5日	10年

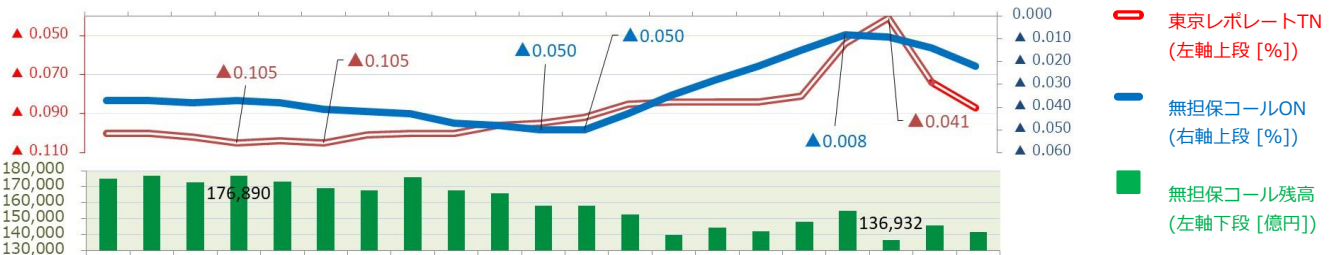
今月の国債買入オペ予定

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。投資については最終決定は、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