



### 短期市場の推移

	12月1日	12月2日	12月5日	12月6日
加重平均金利	▲0.079	▲0.078	▲0.078	▲0.078
東京レボレート(TN)	▲0.119	▲0.114	▲0.107	▲0.101
無コール残	128,300	124,439	130,919	128,223
ON	61,488	57,627	64,797	60,521
その他	66,812	66,812	66,122	67,702
有コール残	30,434	31,128	31,857	31,270

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)			レボ市場
	最低	最高	平均	東京レボレート
O/N	▲0.087	0.001	▲0.077	▲0.098
T/N	-	-	-	▲0.099
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	-	▲0.109
2W	-	-	-	▲0.120
3W	-	-	0.040	▲0.123
1M	-	-	-	▲0.152
2M	-	-	-	-
3M	-	-	0.023	▲0.139
6M	-	-	-	▲0.130
1Y	-	-	-	▲0.125

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8日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
8:50	10月国際収支(経常収支)	6054億円	22:30 (米)新規失業保険申請件数 [前週分]
8:50	7-9月期国内総生産(GDP)改定値[前期比年率]	▲1.1%	(欧) ECB総裁、講演

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▲0.075%の割合から始まり、その後は主に▲0.087%~▲0.075%の水準で取引された。ビッドサイド、オファーサイド共に大きな変化はなくON物加重平均金利(速報)は前営業日+0.001%の▲0.077%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.087 - ▲0.087	-	▲0.078 ~ ▲0.075

### 翌営業日のマーケット

市場参加者の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7日	12月8日	12月9日
券	▲1,300	▲2,900	▲3,000
財政	▲13,000	▲2,900	▲25,000
過不足	▲14,300	▲5,800	▲28,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国庫短期証券買入	▲1,000	▲1,000	▲12,900
国債買入	▲1,000	▲1,000	▲100
共通担保(全店)	▲1,500	▲1,500	▲100
CP等買入	▲200	▲200	▲100
社債等買入	▲200	▲200	▲100
国債補完供給	+12,300	+11,100	+11,100
当座預金増減	▲11,500	+18,100	▲28,000
当座預金残高	4,793,200	4,811,300	4,783,300
準備預金残高	4,168,200	4,166,400	4,166,400
積み終了先	4,166,400	4,166,400	4,166,400
超過準備	4,166,400	4,166,400	4,166,400
非準備預金残高	625,000	625,000	625,000
準備預金進捗率	99.3%	99.3%	99.3%
平均	73.3%	73.3%	73.3%
乖離率	25.9%	25.9%	25.9%

### 12月7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)(12/8~)						
5~10年	0	0				
5~10年	0	0				
5~10年	0	0				
国債買入(12/8~)						
1~3年	4,750	11,996	4,755	0.003	0.004	50.8
5~10年	5,500	21,010	5,509	▲0.002	▲0.001	44.5
10~25年	2,500	3,546	2,507	▲0.012	▲0.010	15.8
国債補完供給(12/7~12/8)						
11,065	11,065	▲0.350	▲0.350			
0	0					

マネタリーベース 【億円】  
12月6日時点 6,065,900

所要	【億円】
今積期の所要準備額	3,836,100
12月8日以降の残り所要	
積数	28,500
平均	3,600

### 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

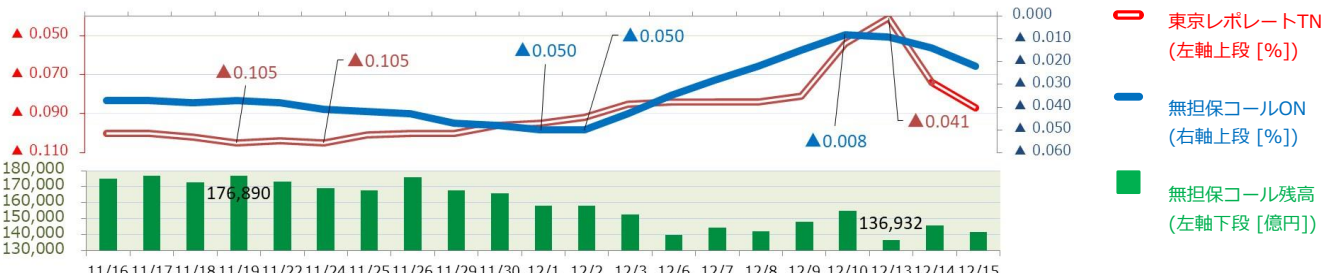
### 今月の国債買入オペ予定

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7日	2
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	12月7日	3
10年超25年以下	2500	2,500	7 19 26	12月7日	2
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