



### 短期市場の推移

	12月2日	12月5日	12月6日	12月7日
加重平均金利	▲0.078	▲0.078	▲0.078	▲0.077
東京レボレート(TN)	▲0.114	▲0.107	▲0.101	▲0.099
無コール残	124,439	130,919	128,223	131,784
ON	57,627	64,797	60,521	63,732
その他	66,812	66,122	67,702	68,052
有コール残	31,128	31,857	31,270	30,657

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	▲0.096
T/N	-	-	-	▲0.101
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.078	▲0.070	▲0.076	▲0.109
2W	-	-	-	▲0.118
3W	-	-	▲0.073	▲0.123
1M	-	-	0.020	▲0.153
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.138
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9日の予定 (時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
8:50	11月マネーストック		22:30	(米)11月生産者物価コア指数[前年比]	-
	-			-	
	-			-	

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▲0.077%の出合から始まり、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)は前営業日対比横ばいの▲0.077%となった。

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

### 翌営業日のマーケット

3日積みもビッドサイドの動向に大きな変化はみられないため、出合水準は本日対比横ばいの地合を予想する。

### 資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想
	12月8日		12月9日		12月12日
券	▲2,900		▲1,400		+1,000
財政	▲2,000		▲24,600		▲3,000
過不足	▲4,900		▲26,000		▲2,000
金融調節	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド
国債買入	+12,900		+200		
CP等買入	▲100		▲800		
国債補完供給	+11,100		+12,200		
当座預金増減	+6,800		▲14,400		▲2,000
当座預金残高	4,800,000		4,785,600		4,783,600
準備預金残高	4,184,000		主な需給要因		
積み終了先	4,182,300		国債発行(5年)		国庫短期証券
超過準備	4,182,300				発行・償還
非準備先残高	616,000				(3M・6M)
準備預金進捗率	99.3%				
平均	76.7%				
乖離率	22.6%				

### 12月8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)(12/9~)						
5~10年	201	201				
5~10年	0	0				
5~10年	0	0				
CP等買入(12/13~)	4,000	9,210	3,970	0.001	0.013	8.3
国債補完供給(12/8~12/9)	12,107	12,107	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マネタリーベース 【億円】  
 12月7日時点 6,055,700

所要	【億円】
今積期の所要準備額	3,836,100
12月9日以降の残り所要	
積数	26,800
平均	3,800

### 国庫短期証券入札予定

12月9日	3ヶ月(第1126回)
12月16日	3ヶ月
12月19日	1年
1月5日	3ヶ月
12月15日	20年
12月27日	2年
1月5日	10年
1月11日	30年

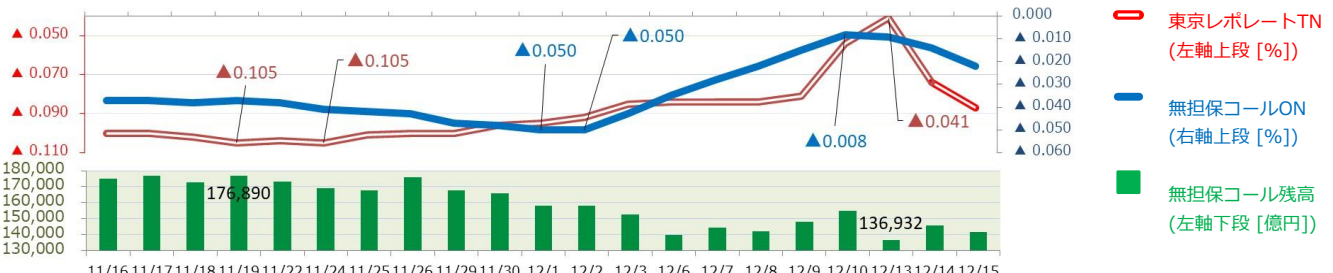
### 今月の国債買入オペ予定

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