



短期市場の推移

	12月5日	12月6日	12月7日	12月8日
加重平均金利	▲0.078	▲0.078	▲0.077	▲0.077
東京レボレート(TN)	▲0.107	▲0.101	▲0.099	▲0.101
無コール残	130,919	128,223	131,784	138,054
ON	64,797	60,521	63,732	68,662
その他	66,122	67,702	68,052	69,392
有コール残	31,857	31,270	30,657	30,118

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	▲0.097
T/N	-	-	-	▲0.099
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	▲0.074	▲0.107
2W	-	-	-	▲0.117
3W	-	-	▲0.069	▲0.152
1M	-	-	-	▲0.151
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12日の予定 (時刻は日本時間)

T38C12	日本	予想	海外	予想
	11月国内企業物価指数[前年比]	-	+8.9%	-
-	-	-	-	-
-	-	-	-	-

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%の合出から始まり、その後は主に▲0.087%~▲0.075%の水準で取引された。3日積みであったものの主だった動態の変化は見られず、ON物加重平均金利(速報)についても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	▲0.080 ~ ▲0.075

翌営業日のマーケット

積み期終盤ではあるが、動向に大きな変化はみられず、合出の水準は本日対比横ばいの圏を想定。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	12月9日	12月12日	12月12日	12月13日	12月13日	12月13日
券	▲1,400	▲1,100	▲1,100	▲2,000	▲2,000	▲2,000
財政	▲25,900	▲14,400	▲14,400	+5,000	+5,000	+5,000
過不足	▲27,300	▲15,500	▲15,500	+3,000	+3,000	+3,000
金融調節	エンド	スタート	エンド	スタート	スタート	スタート
国債買入		+200	+100			
CP等買入	▲800				+4,000	+4,000
社債等買入			▲200			
国債補充供給	+12,200	▲11,000	+11,000			
貸出増加支援						
当座預金増減	▲26,700	▲4,600	▲4,600	+7,000	+7,000	+7,000
当座預金残高	4,773,300	4,768,700	4,768,700	4,775,700	4,775,700	4,775,700
準備預金残高	4,160,100			主な需給要因		
積み終了先	4,158,300			国庫短期証券発行・償還(3M・6M)		
超過準備	4,158,300					
非準備先残高	613,200					
準備預金進捗率	99.4%					
平均	86.7%					
乖離率	12.8%					

12月9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)(12/12~)						
5~10年	124	124				
5~10年	0	0				
5~10年	0	0				
国債補充供給(12/9~12/12)						
	10,942	10,942	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マネタリーベース 【億円】
 12月8日時点 6,065,500

所要	【億円】
今積期の所要準備額	3,836,100
12月12日以降の残り所要	
積数	21,300
平均	5,300

国庫短期証券入札予定

12月16日	3ヶ月(第1127回)
12月19日	1年
1月5日	3ヶ月
1月6日	6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

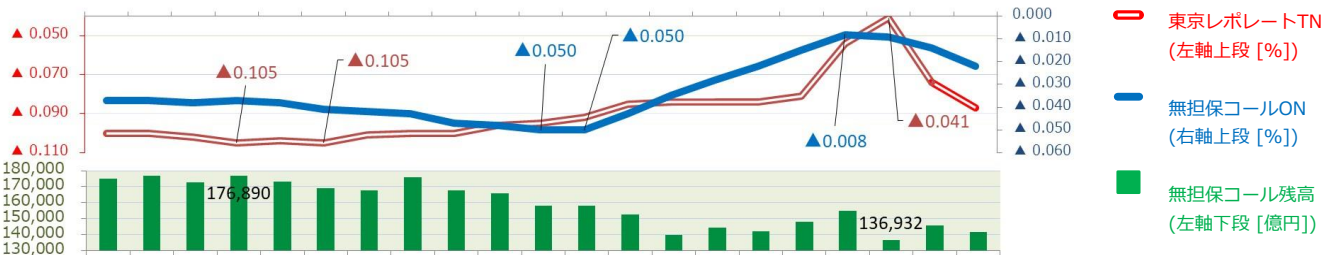
今月の国債買入オペ予定

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