



短期市場の推移

	11月30日	12月1日	12月4日	12月5日
加重平均金利	▲0.022	▲0.015	▲0.013	▲0.011
東京レボレート(TN)	▲0.101	▲0.094	▲0.100	▲0.086
無コール残	164,075	169,737	167,338	166,858
ON	92,233	96,245	92,086	91,276
その他	71,842	73,492	75,252	75,582
有コール残	27,331	28,748	30,124	28,189

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	▲0.010	▲0.086
T/N	-	-	-	▲0.090
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.030	0.008	▲0.023	▲0.113
2W	-	-	0.000	▲0.131
3W	-	-	-	▲0.138
1M	-	-	-	▲0.180
2M	-	-	-	-
3M	-	-	0.026	▲0.166
6M	-	-	-	▲0.115
1Y	-	-	-	▲0.077

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
8:50	貿易収支 (11月上中旬)		(米) 新規失業保険申請件数 (週間)	
14:00	景気動向指数速報 (10月)		-	
15:00	コール市場残高 (11月)		-	

本日の市況

無担保コールON物は▲0.008%の出会いから始まり、その後は主に▲0.015%~▲0.005%を中心に取引された。引き続きビッドサイドの資金調達意欲は強く、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比0.001%上昇の▲0.010%となった。

	都銀・信託	証券	地銀
	- ~ -	▲0.010 ~ ▲0.010	▲0.015 ~ ▲0.005

翌営業日のマーケット

引き続きビッドサイドの調達意欲は旺盛であり、出会いの水準は本日対比横ばい圏を予想する。

資金需給

	日銀速報	日銀予想	当社需給予想
	12月6日	12月7日	12月8日
券	▲1,200	▲2,000	▲2,000
財政	▲32,000	+1,400	▲7,000
過不足	▲33,200	▲600	▲9,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国庫短期証券買入		+1,000	
共通担保(全店)	▲6,400	+6,300	
CP等買入	▲100		
社債等買入	▲300	▲100	
国債補充供給	+40,900	▲37,700	+37,700
当座預金増減	▲29,500	+37,000	▲9,000
当座預金残高	5,298,500	5,335,500	5,326,500
準備預金残高	4,613,500	主な需給要因	
積み終了先	4,613,000	国債発行(30年)	
超過準備	4,613,000		
非準備先残高	685,000		
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
国債補充供給(12/6~12/7)	38,015	38,015	▲0.350	▲0.350	0	0

マナリーベース (億円)
12月5日時点 6,588,000

所要	(億円)
今積期の所要準備額	3,891,200
12月7日以降の残り所要	
積数	3,000
平均	300

国庫短期証券入札予定

12月7日	6ヶ月(第1199回)
12月8日	3ヶ月(第1200回)
12月15日	3ヶ月
12月18日	1年
12月7日	30年
12月12日	5年
12月14日	20年
12月26日	2年

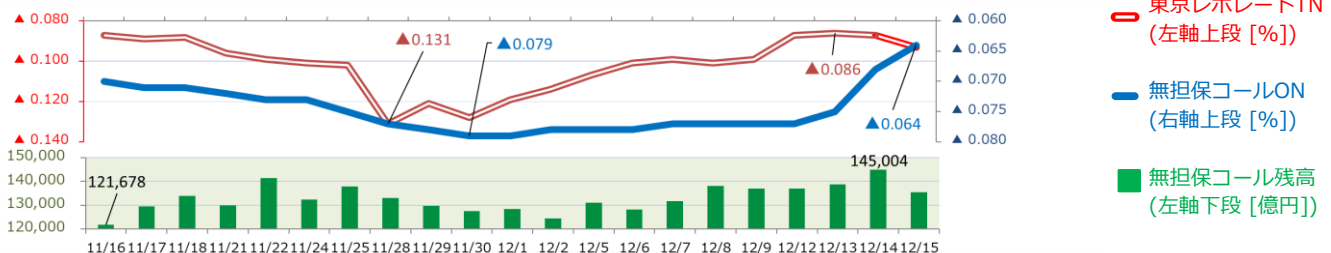
今月の国債買入オペ予定

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	11月10日	1
1年超3年以下	3,500~6,500	3,750	4 8 13 18	12月4日	3
3年超5年以下	4,000~7,500	4,500	4 8 18 25	12月4日	3
5年超10年以下	4,500~9,000	5,250	8 13 18 25	11月29日	4
10年超25年以下	1,000~5,000	1,500	4 8 18 25	12月4日	3
25年超	500~3,500	750	4 13 25	12月4日	2
物価連動債	600	600	月1回	11月29日	1
変動利付債	-	300	-	4月14日	-

1年前の市場推移

○2022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