



## 短期市場の推移

[億円] [%]

	11月28日	12月1日	12月2日	12月3日
加重平均金利	0.477	0.477	0.477	0.478
東京レボレート(TN)	0.500	0.501	0.501	0.501
無コール残	84,028	82,779	81,483	81,830
ON	35,930	34,371	34,401	35,938
その他	48,098	48,408	47,082	45,892
有コール残	25,760	26,854	26,560	27,235

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	0.450	0.530	0.477	0.499
T/N	-	-	-	0.501
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	-	0.496
2W	0.483	0.520	0.496	0.496
3W	-	-	-	0.522
1M	-	-	-	0.576
2M	-	-	-	-
3M	-	-	0.680	0.652
6M	-	-	-	0.694
1Y	-	-	-	0.766

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

## 資金需給

[億円]

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	12月4日		12月5日		12月8日	
券	▲1,900		▲600		▲1,000	
財政	▲4,000		+600		+1,000	
過不足	▲5,900		+0		+0	
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
国債買入	+7,600					
社債等買入	▲100		▲100			
国債補完供給	+3,000		+1,200			
当座預金増減	+3,400		+1,100		+0	
当座預金残高	4,710,900		4,712,000		4,712,000	
準備預金残高	4,330,500		主な需給要因			
積み終了先	4,330,100		国債発行 (30年)		国庫短期証券発行償還 (3M)	
超過準備	4,330,100					
非準備先残高	380,400					
準備預金進捗率	99.9%					
平均	63.3%					
乖離率	36.6%					

## 国庫短期証券入札予定

12月5日	3ヶ月(第1348回)
12月9日	6ヶ月(第1349回)
12月12日	3ヶ月
12月17日	1年

## 国債入札予定

12月9日	5年
12月11日	20年
12月25日	2年
1月6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	1000	1,000	3					12月3日	0
1年超3年以下	3000	3,000	3	10	17			12月3日	2
3年超5年以下	2800	2,800	3	17	24			12月3日	2
5年超10年以下	3050	3,050	10	17	24			11月27日	3
10年超25年以下	1150	1,150	3	17	24			12月3日	2
25年超	750	750	10	24				11月20日	2
物価連動債	500	500	24					11月27日	1
変動利付債	-	300						4月14日	-

## 12月5日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-		(米) 個人消費支出 (9月)	
-		-	
-		-	

## 本日の市況

無担保コールON物は0.477%の出合から始まり、その後も同程度で推移した。ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.001%の0.477%となった。

都銀・信託	証券	地銀
- ~ -	0.477 ~ 0.477	0.477 ~ 0.477

## 翌営業日のマーケット

出合いの水準は本日対比横ばい圏を予想する。

[%][億円]※米ドル資金供給は百万\$

## 12月4日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
------	------	----	----	----	----	----

## 国債補完供給(12/4~12/5)

1,252	1,252	0.250	0.250
0	0		

## マネタリーベース [億円]

12月3日時点 5,924,400

## 所要

[億円]

今積期の所要準備額 3,979,900

12月5日以降の残り所要

積数 2,500

平均 200

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