



短期市場の推移

[億円] [%]

	12月2日	12月3日	12月4日	12月5日
加重平均金利	0.477	0.478	0.477	0.477
東京レボレート(TN)	0.501	0.501	0.501	0.502
無コール残	81,483	81,830	82,044	74,563
ON	34,401	35,938	34,702	28,411
その他	47,082	45,892	47,342	46,152
有コール残	26,560	27,235	27,107	27,083

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	0.650	0.477	0.500
T/N	-	-	-	0.501
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	-	0.497
2W	0.481	0.530	0.501	0.501
3W	-	-	-	0.541
1M	-	-	-	0.603
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	0.676
6M	-	-	-	0.715
1Y	-	-	-	0.779

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8日		12月9日		12月10日	
券	▲1,000		▲1,500		▲1,000	
財政	+1,900		▲500		▲24,000	
過不足	+900		▲2,000		▲25,000	
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
共通担保(全店)	▲500		▲100		▲8,000	
社債等買入	+500		+600			
国債補完供給						
当座預金増減	+300		▲1,500		▲33,000	
当座預金残高	4,711,300		4,709,800		4,676,800	
準備預金残高	4,326,300		主な需給要因			
積み終了先	4,325,900		国庫短期証券発行償還			
超過準備	4,325,900		(6M)			
非準備先残高	385,000		国債発行(5年)			
準備預金進捗率	99.9%					
平均	76.7%					
乖離率	23.2%					

国庫短期証券入札予定

12月9日	6ヶ月(第1349回)
12月12日	3ヶ月(第1350回)
12月17日	1年
12月18日	3ヶ月

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9日の予定(時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
18:00	植田日銀総裁が英FT主催のオンラインイベントに出席			(米) FOMC(1日目)	
	-			(米) 10年国債入札	
	-			-	

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)は前営業日対比横ばいの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
国債補完供給(12/8~12/9)						
	639	639	0.250	0.250		
	0	0				

マネタリーベース [億円]

12月5日時点 5,930,400

所要

今積期の所要準備額 3,987,700

12月9日以降の残り所要

積数 1,000

平均 100

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