



2020年12月22日(火)

	12月16日	12月17日	12月18日	12月21日
加重平均金利	▲0.033	▲0.027	▲0.022	▲0.022
東京レポレート(TN)	▲0.073	▲0.073	▲0.072	▲0.073
無コール残	107,315	111,139	114,760	108,848
ON	66,847	70,646	71,517	63,230
その他	40,468	40,493	43,243	45,618
有コール残	21,938	22,869	22,254	23,801

加重平均金利・コール残高は日銀、東京レポ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)			レポ市場
	最低	最高	平均	東京レポレート
O/N	▲0.075	0.001	▲0.020	▲0.079
T/N	▲0.001	0.001	▲0.001	▲0.083
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.030	▲0.015	▲0.019	▲0.083
2W	▲0.015	0.500	0.094	▲0.092
3W	-	-	0.001	▲0.094
1M	0.010	0.250	0.130	▲0.097
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.102
6M	-	-	-	▲0.123
1Y	-	-	-	▲0.146

無担保コール(速報)は日銀、東京レポレートは日本証券業協会公表

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	12月22日	12月23日	12月23日	12月24日	12月23日	12月24日
券	▲2,300	▲2,600	▲2,600	▲5,000	▲5,000	▲5,000
財政	+1,100	▲6,300	▲6,300	▲6,300	▲6,300	▲6,300
過不足	▲1,200	▲8,900	▲8,900	▲8,900	▲8,900	▲8,900
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
国庫短期証券買入		+20,000				
国債買入		+13,800				
CP等買入	▲300		▲300			
社債等買入	▲200					+2,000
国債補充供給	+100	▲400	+400			
当座預金増減		+31,800		▲8,800		▲3,000
当座預金残高		4,959,800		4,951,000		4,948,000
準備預金残高		4,358,700				主な需給要因
積み終了先		4,357,200				
超過準備		4,357,100				
非準備先残高		601,100				
準備預金進捗率		99.8%				
平均		22.6%				
乖離率		77.2%				

12月23日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
8:50 政策委員会・金融政策 決定会議事要旨 (10月28・29日分)	-	0:00 (米)12月消費者信頼感指数	97.5
-	-	22:30 (米)11月個人消費支出	-0.1%
-	-	(米)週間新規失業保険 申請件数	

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▲0.015%の出合から始まった。
 地銀業態の調達ニーズが強く、その後は主に▲0.020%~▲0.012%の水準で出合が見られた。
 同加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.002%の▲0.020%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.050 ~ ▲0.045	▲0.015 ~ ▲0.015	▲0.020 ~ ▲0.012

翌営業日のマーケット

地銀業態の調達ニーズは強いままで、出合の水準は本日対比横ばいと予想する。

12月22日のオペ結果 [億][億円]*米ドル資金供給は百万\$

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	加分
米ドル資金供給(12/24~1/7)	0	0	0.340	0.340		
米ドル資金供給(12/24~3/18)	0	0	0.340	0.340		
国債補充供給(12/22~12/23)	118	118	▲0.350	▲0.350		
	203	203	▲0.350	▲0.350		

マナタリベース [億円]	所要 [億円]
12月21日時点 6,143,500	今積期の所要準備額 3,581,400
	12月23日以降の残り所要
	積数 8,200
	平均 300

国庫短期証券入札予定

1月5日	3ヶ月
1月7日	6ヶ月
1月8日	3ヶ月
1月15日	3ヶ月
12月24日	2年
1月6日	10年
1月8日	30年
1月13日	5年

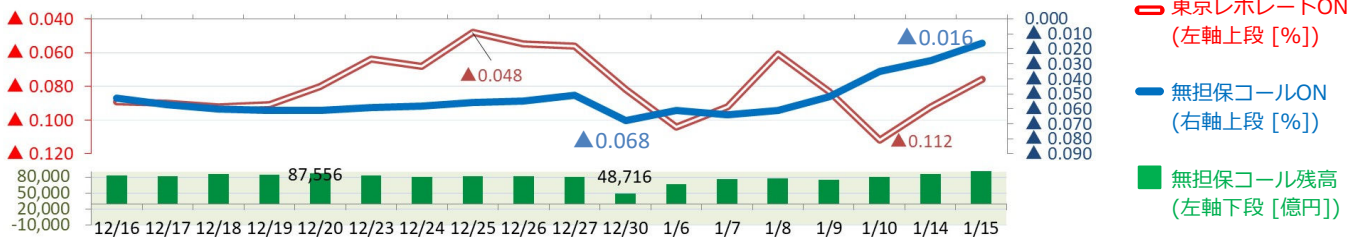
今月の国債買入オペ予定

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	1,000~2,000	1,500	月2回程度	12月16日	0
1年超3年以下	3,500~6,500	5,000	2 7 11 16 21	12月21日	0
3年超5年以下	2,500~6,000	4,200	2 11 16 21 25	12月21日	1
5年超10年以下	2,500~6,000	4,200	4 11 16 21 25	12月21日	1
10年超25年以下	500~2,000	1,200	4 25	12月4日	1
25年超	0~500	300	7 25	12月7日	1
物価連動債	300	300	月2回程度	12月21日	0
変動利付債<偶数月>	500	500	月1回	12月7日	0

1年前の市場推移

○2019年12月積み期 [12月16日~1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