



短期市場の推移

	12月21日	12月22日	12月23日	12月24日
加重平均金利	▲0.022	▲0.020	▲0.019	▲0.021
東京レボレート(TN)	▲0.080	▲0.083	▲0.089	▲0.085
無コール残	108,848	103,226	109,090	113,897
ON	63,230	57,258	62,532	67,119
その他	45,618	45,968	46,558	46,778
有コール残	23,801	23,406	23,673	23,118

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	▲0.080	0.001	▲0.016	▲0.082
T/N	-	-	-	▲0.085
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.010	0.001	▲0.002	▲0.091
2W	-	-	▲0.013	▲0.090
3W	-	-	▲0.010	▲0.093
1M	-	-	-	▲0.096
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.100
6M	-	-	-	▲0.120
1Y	-	-	-	▲0.145

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

	日銀速報	日銀予想	当社需給予想
	12月25日	12月28日	12月29日
券	▲3,100	▲2,900	▲1,000
財政	+9,200	▲1,300	▲3,000
過不足	+6,100	▲4,200	▲4,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国債買入			▲10,100
共通担保(全店)		▲3,500	▲4,700
CP等買入	▲2,000	▲800	
社債等買入	▲100		
国債補完供給	+300		
新型コロナ対応金融支援特別	▲98,400	+99,700	
当座預金増減	+5,600	+6,300	▲4,000
当座預金残高	4,952,000	4,958,300	4,954,300
準備預金残高	4,362,700		
積み終了先	4,362,300		
超過準備	4,361,900		
非準備先残高	589,300		
準備預金進捗率	99.9%		
平均	38.7%		
乖離率	61.2%		

[億円]

12月25日のオペ結果

[%][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	按分
------	------	----	----	----	----	----

国債買入(12/28~)						
3~5年	4,200	10,653	4,200	0.002	0.003	86.4
5~10年	4,200	11,635	4,206	▲0.004	▲0.002	60.0
10~25年	1,200	6,861	1,201	0.005	0.007	7.7
25年~	300	1,641	301	0.008	0.009	46.7

CP等買入(12/30~)
6,000 11,735 5,975 ▲0.032 ▲0.022 41.2

国債補完供給(12/25~12/28)
8 8 ▲0.350 ▲0.350
0 0

共通担保(全店)(12/28~1/13)
20,000 4,651 4,651

マネタリーベース [億円]

12月24日時点 6,171,000

所要

今積期の所要準備額	3,581,400
12月28日以降の残り所要	
積数	2,000
平均	100

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

国債入札予定

1月6日	10年
1月8日	30年
1月13日	5年
1月19日	20年

今月の国債買入オペ予定

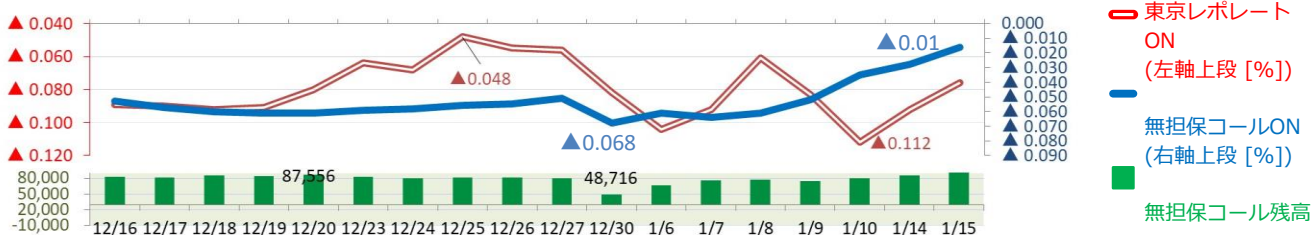
オペ種類	一回当たりオファー金額	直近オファー額	オファー予定日	直近日	残り回数
1年以下	1,000~2,000	1,500	月2回程度	12月16日	0
1年超3年以下	3,500~6,500	5,000	2 7 11 16 21	12月21日	0
3年超5年以下	2,500~6,000	4,200	2 11 16 21 25	12月25日	0
5年超10年以下	2,500~6,000	4,200	4 11 16 21 25	12月25日	0
10年超25年以下	500~2,000	1,200	4 25	12月25日	0
25年超	0~500	300	7 25	12月25日	0
物価連動債	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	#VALUE!

[億円]

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