



短期市場の推移

	12月1日	12月2日	12月3日	12月6日
加重平均金利	▲0.050	▲0.050	▲0.043	▲0.035
東京レボレート(TN)	▲0.095	▲0.092	▲0.085	▲0.084
無コール残	158,139	158,192	152,830	139,967
ON	81,751	80,524	72,872	59,334
その他	76,388	77,668	79,958	80,633
有コール残	18,610	18,465	18,711	18,482

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	▲0.070	0.001	▲0.028	▲0.084
T/N	-	-	▲0.010	▲0.084
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.015	▲0.001	▲0.012	▲0.086
2W	▲0.012	▲0.010	▲0.011	▲0.091
3W	-	-	-	▲0.095
1M	-	-	-	▲0.109
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.116
6M	-	-	-	▲0.127
1Y	-	-	-	▲0.134

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8日の予定 (時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
8:50	10月国際収支(経常収支)	11684億円	(欧) ラガルドECB総裁がESRBのイベントで冒頭挨拶	
8:50	7-9月期国内総生産(GDP)改定値[前期比年率]	▲3.2%	-	
	-	-	-	

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▲0.001%の出合から始まり、その後は主に▲0.040%~▲0.015%のレンジで推移した。ビットサイドでは様々な業態で調達に積極的に動く様子も見られ、本日の同加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.007%の▲0.028%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.070 ~ ▲0.065	▲0.020 ~ ▲0.015	▲0.030 ~ ▲0.001

翌営業日のマーケット

引き続きビットサイドの調達ニーズは強く、出合水準は本日対比上昇と予想。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	12月7日	12月8日	12月8日	12月9日	12月9日	12月9日
券	▲1,100	▲900	▲900	▲1,000	▲1,000	▲1,000
財政	+2,500	▲8,600	▲8,600	+0	+0	+0
過不足	+1,400	▲9,500	▲9,500	▲1,000	▲1,000	▲1,000
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
国庫短期証券買入				+1,000		
共通担保(全店)			▲2,600	+2,500		
CP等買入	▲100		▲200			
社債等買入			▲100			
国債補充供給	+500	▲500	+500			
当座預金増減	+1,300	▲8,400	▲8,400	▲1,000	▲1,000	▲1,000
当座預金残高	5,261,100	5,252,700	5,252,700	5,251,700	5,251,700	5,251,700
準備預金残高	4,669,000					
積み終了先	4,669,000					
超過準備	4,669,000					
非準備先残高	592,100					
準備預金進捗率	99.9%					
平均	73.3%					
乖離率	26.6%					

12月7日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
国庫短期証券買入(12/8~)	1,000	7,805	1,001	0.015	0.015	90.6
米ドル資金供給(12/9~12/16)	3	3	0.330	0.330		
社債等買入(12/10~)	1,250	2,204	1,251	▲0.042	▲0.032	34.2
国債補充供給(12/7~12/8)	518	518	▲0.350	▲0.350		
共通担保(全店)(12/8~12/22)	20,000	2,501	2,501			

マネタリーベース (億円)
12月6日時点 6,490,900

所要	所要
今積期の所要準備額	3,637,700
12月8日以降の残り所要	
積数	100
平均	0

国庫短期証券入札予定

12月9日	6ヶ月(第1043回)
12月10日	3ヶ月(第1044回)
12月14日	6ヶ月(第1045回)
12月15日	1年
12月9日	5年
12月16日	20年
12月27日	2年
9月2日	10年

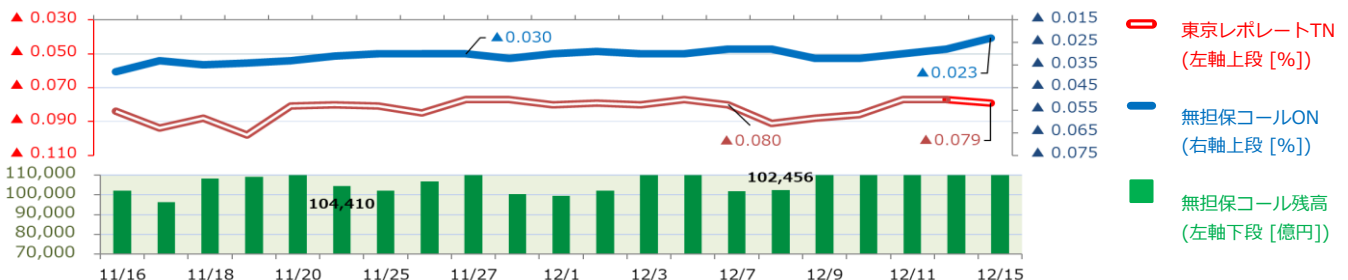
今月の国債買入オペ予定

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	1500	1,500	月1回	11月24日	1
1年超3年以下	4500	4,500	3 8 15 21	12月3日	3
3年超5年以下	4500	4,500	3 15 21 24	12月3日	3
5年超10年以下	4250	4,250	8 15 21 24	11月29日	4
10年超25年以下	1500	1,500	3	12月3日	0
25年超	500	500	15	11月17日	1
物価連動債	600	600	月1回	11月29日	1
変動利付債<四半期>	300	300	四半期に1回	10月13日	0

1年前の市場推移

○2020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