



短期市場の推移

[億円] [%]

	12月7日	12月8日	12月9日	12月10日
加重平均金利	▲0.028	▲0.022	▲0.015	▲0.008
東京レボレート(TN)	▲0.084	▲0.084	▲0.081	▲0.054
無コール残	144,323	142,243	148,090	154,891
ON	62,170	61,615	66,662	73,303
その他	82,153	80,628	81,428	81,588
有コール残	17,981	17,766	17,864	20,452

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	▲0.040	0.001	▲0.009	▲0.046
T/N	-	-	-	▲0.041
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	▲0.003	▲0.069
2W	▲0.001	0.050	0.017	▲0.080
3W	-	-	-	▲0.099
1M	-	-	-	▲0.102
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.113
6M	-	-	-	▲0.122
1Y	-	-	-	▲0.133

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13日	12月14日	12月13日	12月14日	12月13日	12月14日
券		▲1,100		▲2,200		▲2,000
財政		▲300		+5,500		+65,000
過不足		▲1,400		+3,300		+63,000
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
国債買現先		+10,000		▲10,000		
CP等買入		▲200		▲300		
国債補完供給		+300		+500		
貸出増加支援					▲28,900	+20,100
当座預金増減		+8,200		▲6,500		+54,200
当座預金残高		5,239,100		5,232,600		5,286,800
準備預金残高		4,654,600				
積み終了先		4,654,600				
超過準備		4,654,600				
非準備先残高		584,500				
準備預金進捗率		100.0%				
平均		93.3%				
乖離率		6.7%				

12月13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
------	------	----	----	----	----	----

国債買現先(12/13~12/14)
 10,000 10,000 ▲0.060 ▲0.060

国債補完供給(12/13~12/14)
 446 446 ▲0.350 ▲0.350
 0 0

貸出増加支援 (2021/12/15~2025/12/15)
 20,129 20,129

マネタリーベース [億円]
 12月10日時点 6,467,400

所要 [億円]
 今積期の所要準備額 3,637,700
 12月14日以降の残り所要
 積数 0
 平均 0

国庫短期証券入札予定

今月の国債買入オペ予定

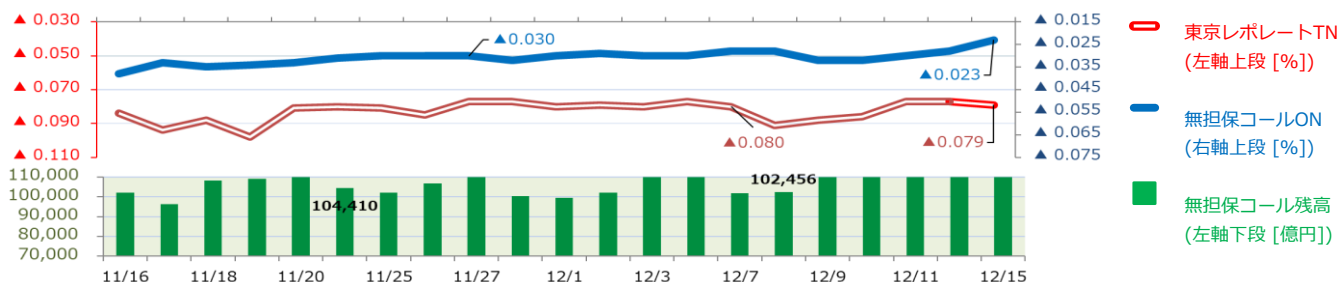
12月14日	6ヶ月(第1045回)
12月15日	1年(第1046回)
12月16日	3ヶ月(第1047回)
9月3日	3ヶ月
国債入札予定	
12月16日	20年
12月27日	2年
9月2日	10年
9月7日	30年

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	12月8日	0
1年超3年以下	4500	4,500	3 8 15 21	12月8日	2
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	12月8日	3
10年超25年以下	1500	1,500	3 15	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