



短期市場の推移

	12月8日	12月9日	12月10日	12月13日
加重平均金利	▲0.022	▲0.015	▲0.008	▲0.009
東京レボレート(TN)	▲0.084	▲0.081	▲0.054	▲0.041
無コール残	142,243	148,090	154,891	136,932
ON	61,615	66,662	73,303	60,479
その他	80,628	81,428	81,588	76,453
有コール残	17,766	17,864	20,452	17,808

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	▲0.050	0.001	▲0.014	▲0.049
T/N	-	-	▲0.010	▲0.074
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.010	▲0.003	▲0.007	▲0.091
2W	▲0.050	0.150	▲0.022	▲0.094
3W	-	-	-	▲0.101
1M	▲0.040	0.020	▲0.025	▲0.103
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.114
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

12月15日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	FOMCの結果	-
-	-	パウエルFRB議長の会見	-
-	-	-	-
-	-	-	-

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▲0.010%の合出から始まり、その後は主に▲0.030%~▲0.005%のレンジで推移した。積み到着地の目途がついたことで調達を控える先が増え、本日の同加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.005%の▲0.014%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.030 ~ ▲0.020	▲0.025 ~ ▲0.020	▲0.020 ~ ▲0.005

翌営業日のマーケット

積み最終日においてビッドサイドの調達意欲は限定的であり、軟調な地合になると予想。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	12月14日	12月15日	12月14日	12月15日	12月14日	12月15日
券	▲2,200	▲2,200	▲2,200	▲2,200	▲4,000	▲4,000
財政	+5,000	+66,300	+5,000	+66,300	+2,000	+2,000
過不足	+2,800	+64,100	+2,800	+64,100	+2,000	+2,000
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	+20,000	▲20,000	+29,000	▲29,000	▲29,000
CP等買入	▲300		▲900			
社債等買入			▲100			
国債補充供給	+500	▲200	+200			
貸出増加支援			▲17,900	+20,100		
当座預金増減	+12,800	+74,500	+12,800	+74,500	▲31,000	▲31,000
当座預金残高	5,251,900	5,326,400	5,251,900	5,326,400	5,295,400	5,295,400
準備預金残高	4,665,200	4,665,200	4,665,200	4,665,200	4,665,200	4,665,200
積み終了先	4,665,200	4,665,200	4,665,200	4,665,200	4,665,200	4,665,200
超過準備	4,665,200	4,665,200	4,665,200	4,665,200	4,665,200	4,665,200
非準備先残高	586,700	586,700	586,700	586,700	586,700	586,700
準備預金進捗率	100.0%	100.0%	100.0%	100.0%	100.0%	100.0%
平均	96.7%	96.7%	96.7%	96.7%	96.7%	96.7%
乖離率	3.3%	3.3%	3.3%	3.3%	3.3%	3.3%

12月14日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
国債買現先(12/15~12/16)	70,000	28,629	28,629	▲0.100	▲0.100	90.1
国債買現先・即日(12/14~12/15)	20,000	22,210	20,002	▲0.100	▲0.100	
CP等買入(12/17~)	5,000	8,261	4,996	▲0.014	▲0.010	3.2
国債補充供給(12/14~12/15)	230	230	▲0.250	▲0.250		
	1	1	▲0.250	▲0.250		

マネタリーベース (億円)
12月13日時点 6,476,800

所要	(億円)
今積期の所要準備額	3,637,700
12月15日以降の残り所要	
積数	0
平均	0

国庫短期証券入札予定

12月15日	1年 (第1046回)
12月16日	3ヶ月 (第1047回)
1月5日	3ヶ月
1月6日	6ヶ月
12月16日	20年
12月27日	2年
1月5日	10年
1月7日	30年

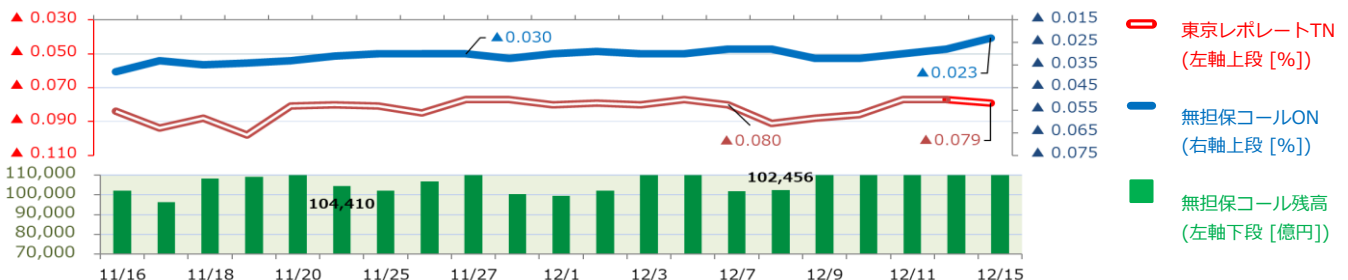
今月の国債買入オペ予定

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	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	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