



短期市場の推移

	12月13日	12月14日	12月15日	12月16日
加重平均金利	▲0.009	▲0.014	▲0.022	▲0.033
東京レポレート(TN)	▲0.041	▲0.074	▲0.087	▲0.089
無コール残	136,932	145,813	141,874	174,171
ON	60,479	72,310	68,846	99,063
その他	76,453	73,503	73,028	75,108
有コール残	17,808	17,967	18,153	17,993

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	▲0.070	0.001	▲0.028	▲0.085
T/N	▲0.040	▲0.010	▲0.032	▲0.087
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.020	▲0.015	▲0.019	▲0.091
2W	-	-	-	▲0.099
3W	-	-	-	▲0.102
1M	▲0.025	0.005	▲0.006	▲0.102
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.111
6M	-	-	-	▲0.121
1Y	-	-	-	▲0.132

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

12月20日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
【記者会見要旨】黒田総裁 (12月17日分)		-	
-		-	
-		-	

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

12月積み期初日の本日の無担保コールON物は▲0.030%の出合から始まり、その後は主に▲0.040%～▲0.010%のレンジで推移した。週末3日積みということもあり調達意欲は強く、本日の同加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.005%の▲0.028%となった。また、日本銀行は本日の金融政策決定会合にて、新型コロナ対応資金繰り支援特別プログラムの一部について延長を発表した。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.040 ~ ▲0.040	- ~ -	▲0.040 ~ ▲0.010

翌営業日のマーケット

引き続きビッドサイドで調達のニーズはあるものの、3日積み要因剥落により、出合いの水準は本日対比で横ばいかやや低下と予想。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	12月17日	12月20日	12月20日	12月21日	12月21日	12月21日
券	▲2,400	▲2,000	▲2,000	▲4,000	▲4,000	▲4,000
財政	▲2,600	+74,400	+74,400	▲1,000	▲1,000	▲1,000
過不足	▲5,000	+72,400	+72,400	▲5,000	▲5,000	▲5,000
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
CP等買入	▲800	+5,000	▲300	▲300	▲300	▲300
社債等買入	-	-	▲600	▲600	▲600	▲600
国債補完供給	+200	▲100	+100	+100	+100	+100
当座預金増減	▲700	+71,600	+71,600	▲5,000	▲5,000	▲5,000
当座預金残高	5,306,900	5,378,500	5,378,500	5,373,500	5,373,500	5,373,500
準備預金残高	4,700,600	4,700,600	4,700,600	4,700,600	4,700,600	4,700,600
積み終了先	4,699,900	4,699,900	4,699,900	4,699,900	4,699,900	4,699,900
超過準備	4,552,100	4,552,100	4,552,100	4,552,100	4,552,100	4,552,100
非準備先残高	606,300	606,300	606,300	606,300	606,300	606,300
準備預金進捗率	99.9%	99.9%	99.9%	99.9%	99.9%	99.9%
平均	12.9%	12.9%	12.9%	12.9%	12.9%	12.9%
乖離率	87.0%	87.0%	87.0%	87.0%	87.0%	87.0%

12月17日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
国債補完供給(12/17~12/20)	96	96	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マネタリーベース [億円]
12月16日時点 6,553,000

所要	[億円]
今積期の所要準備額	3,769,300
12月20日以降の残り所要	
積数	5,500
平均	200

国庫短期証券入札予定

1月5日	3ヶ月
1月6日	6ヶ月
1月7日	3ヶ月
1月14日	3ヶ月
12月27日	2年
1月5日	10年
1月7日	30年
1月12日	5年

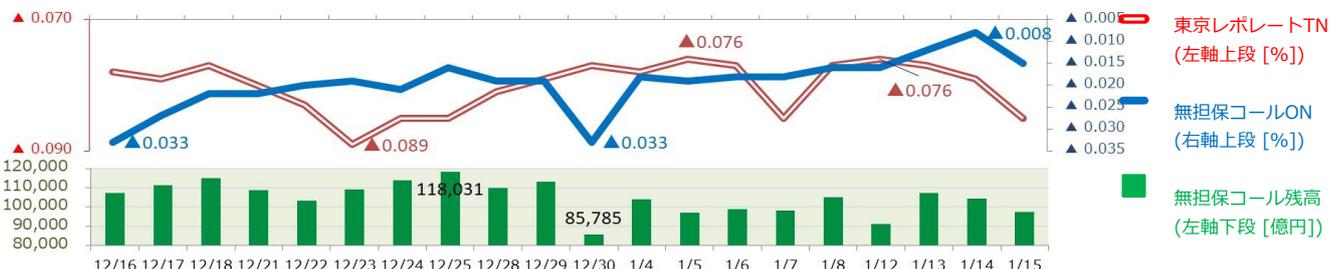
今月の国債買入オペ予定

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	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15日	1
3年超5年以下	4500	4,500	3 15 21 24	12月15日	2
5年超10年以下	4250	4,250	8 15 21 24	12月15日	2
10年超25年以下	1500	1,500	3	12月3日	0
25年超	500	500	15	12月15日	0
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