



短期市場の推移

	12月14日	12月15日	12月16日	12月17日
加重平均金利	▲0.014	▲0.022	▲0.033	▲0.028
東京レボレート(TN)	▲0.074	▲0.087	▲0.089	▲0.087
無コール残	145,813	141,874	174,171	177,390
ON	72,310	68,846	99,063	101,947
その他	73,503	73,028	75,108	75,443
有コール残	17,967	18,153	17,993	18,625

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	▲0.060	0.001	▲0.028	▲0.084
T/N	▲0.043	▲0.010	▲0.026	▲0.087
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.020	▲0.015	▲0.018	▲0.090
2W	-	-	-	▲0.098
3W	-	-	-	▲0.099
1M	-	-	0.005	▲0.102
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.110
6M	-	-	-	▲0.121
1Y	-	-	-	▲0.131

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21日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	-	-
-	-	-	-
-	-	-	-

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▲0.030%の合出から始まり、その後は主に▲0.048%~▲0.010%のレンジで推移した。オファーサイド、ビッドサイドの動向に大きな変化はなく、本日の同加重平均金利(速報)は前営業日対比横ばいの▲0.028%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.048 ~ ▲0.048	- ~ -	▲0.040 ~ ▲0.010

翌営業日のマーケット

大きな地合いの変化はないと思われ、出合い水準は本日対比横ばい圏を予想。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想
	12月20日	12月21日	12月21日	12月22日	12月22日
券	▲2,000	▲2,700	▲2,700	▲3,000	▲3,000
財政	+72,100	▲5,900	▲5,900	▲1,000	▲1,000
過不足	+70,100	▲8,600	▲8,600	▲4,000	▲4,000
金融調節	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド
国庫短期証券買入			+1,000		
共通担保(全店)				▲2,500	
CP等買入	▲300		▲300		
社債等買入	▲600				
国債補充供給	+100	▲100	+100		
当座預金増減	+69,200	▲7,800	▲7,800	▲6,500	▲6,500
当座預金残高	5,376,100	5,368,300	5,368,300	5,361,800	5,361,800
準備預金残高	4,766,700				
積み終了先	4,766,200				
超過準備	4,766,100				
非準備先残高	609,400				
準備預金進捗率	99.9%				
平均	16.1%				
乖離率	83.7%				

12月20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(12/21~)	1,000	9,618	1,001	0.005	0.008	14.0
国債補充供給(12/20~12/21)	65	65	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マネタリーベース (億円)
12月17日時点 6,554,600

所要 (億円)
今積期の所要準備額 3,769,300
12月21日以降の残り所要
積数 4,900
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	1年
12月27日	2年
1月5日	10年
1月7日	30年
1月12日	5年

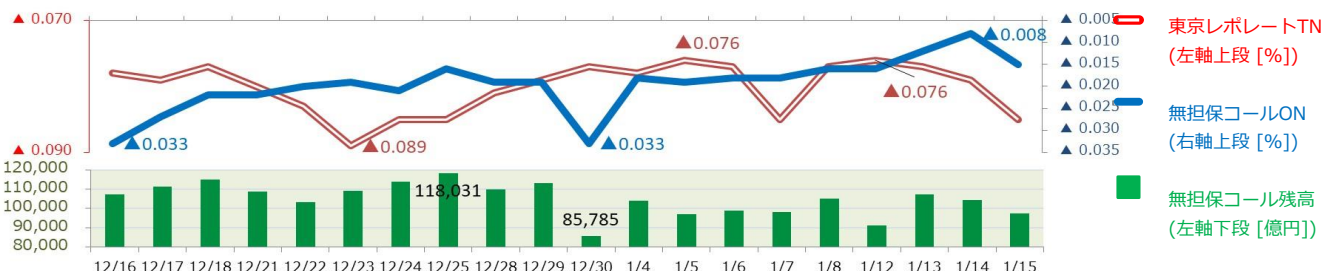
今月の国債買入オペ予定

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