



短期市場の推移

	12月15日	12月16日	12月17日	12月20日
加重平均金利	▲0.022	▲0.033	▲0.028	▲0.028
東京レポレート(TN)	▲0.087	▲0.089	▲0.087	▲0.087
無コール残	141,874	174,171	177,390	179,797
ON	68,846	99,063	101,947	102,874
その他	73,028	75,108	75,443	76,923
有コール残	18,153	17,993	18,625	17,743

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	▲0.060	0.001	▲0.028	▲0.084
T/N	▲0.043	▲0.010	▲0.034	▲0.087
S/N	-	-	▲0.010	-
1W	▲0.025	0.250	0.014	▲0.089
2W	-	-	0.010	▲0.098
3W	-	-	-	▲0.098
1M	-	-	-	▲0.102
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.109
6M	-	-	-	▲0.120
1Y	-	-	-	▲0.131

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22日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	22:30 (米)7-9月期国内総生産(GDP)確報値[前期比年率]	2.1%
-	-	-	-
-	-	-	-

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
▲0.050 ~ ▲0.050	- ~ -	▲0.050 ~ ▲0.020

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21日	12月22日	12月21日	12月22日	12月21日	12月22日
券	▲2,700	▲2,600	▲2,600	▲2,600	▲4,000	▲4,000
財政	▲5,600	+3,300	+3,300	+3,300	+0	+0
過不足	▲8,300	+700	+700	+700	▲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	スタート
国庫短期証券買入		+1,000				
国債買入				+13,500		
共通担保(全店)			▲2,500	+5,600		
CP等買入	▲300		▲600			
社債等買入			▲100			
国債補充供給	+100					
当座預金増減	▲7,500	+16,600	+16,600	+16,600	▲4,000	▲4,000
当座預金残高	5,368,600	5,385,200	5,385,200	5,385,200	5,381,200	5,381,200
準備預金残高	4,736,300	主な需給要因				
積み終了先	4,735,800					
超過準備	4,735,800					
非準備先残高	632,300					
準備預金進捗率	99.9%					
平均	19.4%					
乖離率	80.5%					

12月21日のオペ結果

オベ種類 オファー 応札 落札 足切 平均 按分

国債買入(12/22~)	1~3年	4,500	13,553	4,505	0.005	0.005	69.8
3~5年	4,500	12,258	4,505	0.005	0.005	62.0	
5~10年	4,250	11,610	4,262	0.007	0.007	92.9	

米ドル資金供給(12/23~12/30)

1	1	0.330	0.330
---	---	-------	-------

社債等買入(12/24~)

750	2,414	750	0.172	0.185	3.4
-----	-------	-----	-------	-------	-----

国債補充供給(12/21~12/22)

7	7	▲0.350	▲0.350
0	0		

共通担保(全店)(12/22~1/5)

20,000	5,550	5,550
--------	-------	-------

マネタリーベース (億円)

12月20日時点	6,625,700
----------	-----------

所要

今積期の所要準備額	3,769,300
-----------	-----------

12月22日以降の残り所要	
---------------	--

積数	4,300
----	-------

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

国債入札予定

12月27日	2年
1月5日	10年
1月7日	30年
1月12日	5年

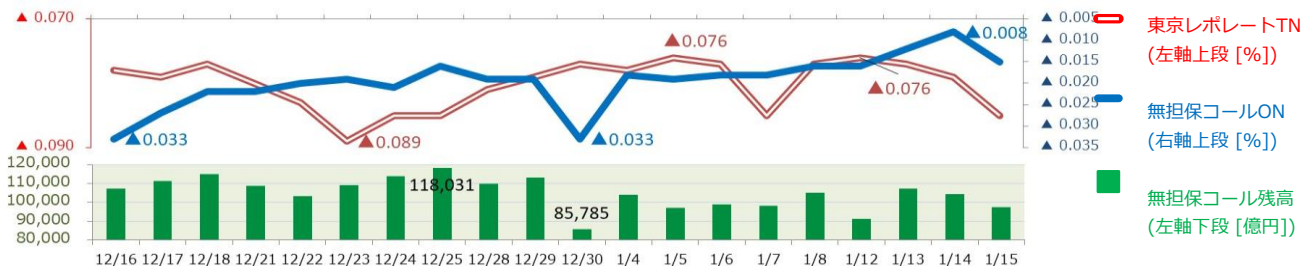
今月の国債買入オペ予定

オベ種類	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21日	0
3年超5年以下	4500	4,500	3 15 21 24	12月21日	1
5年超10年以下	4250	4,250	8 15 21 24	12月21日	1
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