



短期市場の推移

	12月20日	12月21日	12月22日	12月23日
加重平均金利	▲0.028	▲0.028	▲0.028	▲0.027
東京レボレート(TN)	▲0.087	▲0.087	▲0.086	▲0.074
無コール残	179,797	180,445	183,000	181,088
ON	102,874	102,062	102,817	100,485
その他	76,923	78,383	80,183	80,603
有コール残	17,743	17,801	17,593	18,472

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	▲0.070	0.001	▲0.023	▲0.067
T/N	▲0.045	▲0.010	▲0.025	▲0.079
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	-	▲0.084
2W	-	-	▲0.045	▲0.088
3W	-	-	-	▲0.091
1M	-	-	▲0.017	▲0.096
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.108
6M	-	-	-	▲0.119
1Y	-	-	-	▲0.129

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27日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
金融政策決定会合における主な意見			
-		-	
-		-	

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

3日積みである本日の無担保コールON物は▲0.025%の出合から始まり、その後は主に▲0.045%~▲0.010%のレンジで推移した。一部、運用サイドの放出ニーズの減退が見られたため、本日の同加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.004%の▲0.023%となった。

都銀・信託	証券	地銀
- ~ -	▲ 0.025 ~ ▲ 0.025	▲ 0.050 ~ ▲ 0.005

翌営業日のマーケット

オファー・ビッドの動向に大きな変化はなく、出合いの水準は横ばい圏を想定。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	12月24日		12月27日		12月28日	
券	▲2,900		▲3,000		▲2,000	
財政	+4,200		+20,100		▲3,000	
過不足	+1,300		+17,100		▲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
国債買入				+9,500		
国債買現先				+15,200		
CP等買入	▲800		▲1,000			
社債等買入	▲100	+800				
国債補充供給	+100					
気候変動対応オペ		+20,500				
新型コロナ対応金融支援特別			▲107,700	+124,700		
当座預金増減	+21,800		+57,800		▲5,000	
当座預金残高	5,404,300		5,462,100		5,457,100	
準備預金残高	4,798,200		主な需給要因			
積み終了先	4,797,800					
超過準備	4,797,800					
非準備先残高	606,100					
準備預金進捗率	99.9%					
平均	35.5%					
乖離率	64.4%					

12月24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(12/27~12/30)	15,000	20,037	15,002	▲0.100	▲0.086	35.2
国債買入(12/27~)	3~5年	4,500	9,475	4,504	▲0.002	0.000 92.3
	5~10年	4,250	10,574	4,253	▲0.001	0.000 10.3
物価連動	600	1,873	600	0.040	▲0.075	95.5
国債補充供給(12/24~12/27)	41	41	▲0.350	▲0.350		
	0	0				
新型コロナ対応金融支援特別(12/27~6/28)	124,679	124,679				

マネタリーベース (億円)
 12月23日時点 6,641,500

所要	今積期の所要準備額
12月27日以降の残り所要	3,769,300
積数	2,200
平均	100

国債短期証券入札予定

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