



デイリーシグナル

2020年12月23日(水)

短期市場の推移

	12月17日	12月18日	12月21日	12月22日
加重平均金利	▲0.027	▲0.022	▲0.022	▲0.020
東京レポレート(TN)	▲0.079	▲0.077	▲0.080	▲0.083
無コール残	111,139	114,760	108,848	103,226
ON	70,646	71,517	63,230	57,258
その他	40,493	43,243	45,618	45,968
有コール残	22,869	22,254	23,801	23,406

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	▲0.019	▲0.084
T/N	▲0.001	0.002	▲0.001	▲0.089
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.040	▲0.013	▲0.018	▲0.091
2W	-	-	▲0.015	▲0.092
3W	-	-	-	▲0.095
1M	-	-	-	▲0.097
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.102
6M	-	-	-	▲0.123
1Y	-	-	-	▲0.146

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24日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	【講演】黒田総裁 (日本経済団体連合会 審議員会)	0:00	(米)11月新築住宅販売件数
-	-	-	99万戸
-	-	-	-
-	-	-	-

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▲0.015%の出合から始まった。
 地銀業態の調達ニーズが強く、その後は主に▲0.020%~▲0.012%の水準で出合が見られた。
 同加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.001%の▲0.019%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.050 ~ ▲0.040	▲0.015 ~ ▲0.015	▲0.020 ~ ▲0.012

翌営業日のマーケット

引き続き地銀業態の調達ニーズは強く、出合の水準は本日対比横ばいと予想する。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	12月23日	12月24日	12月24日	12月25日	12月25日	12月26日
券	▲2,600	▲4,000	▲4,000	▲4,000	▲4,000	▲4,000
財政	▲7,000	▲300	▲300	▲300	▲300	+4,000
過不足	▲9,600	▲4,300	▲4,300	▲4,300	▲4,300	+0
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	▲300	▲600	▲600	▲600	▲600	▲600
社債等買入	-	-	-	+2,000	-	-
国債補完供給	+400	▲200	+200	+200	+200	+200
新型コロナ対応金融支援特別	-	-	-	-	-	▲98,400
当座預金増減	▲9,700	▲2,700	▲2,700	▲2,700	▲2,700	▲98,400
当座預金残高	4,950,100	4,947,400	4,947,400	4,947,400	4,947,400	4,849,000
準備預金残高	4,329,400	主な需給要因				
積み終了先	4,327,500					
超過準備	4,327,500					
非準備先残高	620,700					
準備預金進捗率	99.8%					
平均	25.8%					
乖離率	74.0%					

12月23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(12/23~12/24)			
165	165	▲0.350	▲0.350
61	61	▲0.350	▲0.350

マネタリーベース [億円]
 12月22日時点 6,177,600

所要 [億円]	
今積期の所要準備額	3,581,400
12月24日以降の残り所要	
積数	6,300
平均	300

国債短期証券入札予定

1月5日	3ヶ月
1月7日	6ヶ月
1月8日	3ヶ月
1月15日	3ヶ月
国債入札予定	
12月24日	2年
1月6日	10年
1月8日	30年
1月13日	5年

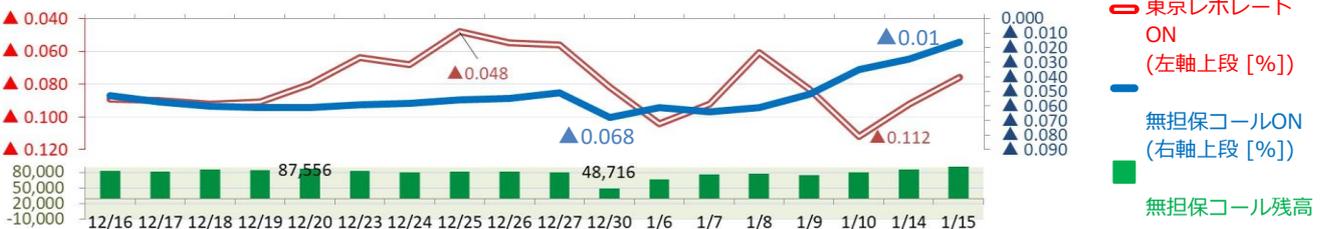
今月の国債買入オペ予定

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	1,000~2,000	1,500	月2回程度	12月16日	0
1年超3年以下	3,500~6,500	5,000	2 7 11 16 21	12月21日	0
3年超5年以下	2,500~6,000	4,200	2 11 16 21 25	12月21日	1
5年超10年以下	2,500~6,000	4,200	4 11 16 21 25	12月21日	1
10年超25年以下	500~2,000	1,200	4 25	12月4日	1
25年超	0~500	300	7 25	12月7日	1
物価運動債	300	300	月2回程度	12月21日	0
変動利付債<偶数月>	500	500	月1回	12月7日	0

1年前の市場推移

○2019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