



デイリーシグナル

2020年12月24日(木)

短期市場の推移

	12月18日	12月21日	12月22日	12月23日
加重平均金利	▲0.022	▲0.022	▲0.020	▲0.019
東京レボレート(TN)	▲0.077	▲0.080	▲0.083	▲0.089
無コール残	114,760	108,848	103,226	109,090
ON	71,517	63,230	57,258	62,532
その他	43,243	45,618	45,968	46,558
有コール残	22,254	23,801	23,406	23,673

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	▲0.065	0.001	▲0.021	▲0.082
T/N	▲0.040	0.005	▲0.003	▲0.085
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	0.010	▲0.091
2W	-	-	▲0.014	▲0.092
3W	-	-	-	▲0.095
1M	-	-	-	▲0.096
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.102
6M	-	-	-	▲0.123
1Y	-	-	-	▲0.146

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25日の予定 (時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
8:30	11月有効求人倍率	1.04倍	-	(その他)休場 (クリスマス:米英香)	-
8:30	11月失業率	+3.1%	-	-	-
-	-	-	-	-	-

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▲0.013%の出合から始まった。
 昨日に引き続き地銀業態の調達ニーズが強く、その後は主に▲0.015%~▲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▲0.002%の▲0.021%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.050 ~ ▲0.040	▲0.015 ~ ▲0.010	▲0.035 ~ ▲0.012

翌営業日のマーケット

週末三日積み要因から、出合の水準は本日対比上昇を想定する。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	12月24日	12月25日	12月25日	12月28日	12月28日	12月28日
券	▲4,100	▲3,000	▲3,000	▲1,000	▲1,000	▲1,000
財政	▲900	+9,100	+9,100	▲2,000	▲2,000	▲2,000
過不足	▲5,000	+6,100	+6,100	▲3,000	▲3,000	▲3,000
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	▲600	▲2,000	▲2,000			
社債等買入		+2,000	▲100		▲3,500	
国債補完供給	+200	▲300	+300			
新型コロナ対応金融支援特別		▲98,400	+99,700			
当座預金増減	▲3,700	+5,600	+5,600	▲6,500	▲6,500	▲6,500
当座預金残高	4,946,400	4,952,000	4,952,000	4,945,500	4,945,500	4,945,500
準備預金残高	4,334,400					
積み終了先	4,332,500					
超過準備	4,332,500					
非準備先残高	612,000					
準備預金進捗率	99.9%					
平均	29.0%					
乖離率	70.8%					

12月24日のオペ結果

【%】(億円)※米ドル資金供給は百万\$

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
------	------	----	----	----	----	----

国債補完供給(12/24~12/25)	330	330	▲0.350	▲0.350		
新型コロナ対応金融支援特別(12/25~6/25)	0	0				
	99,697	99,697				

マネタリーベース (億円)
 12月23日時点 6,170,600

所要	(億円)
今積期の所要準備額	3,581,400
12月25日以降の残り所要	
積数	4,400
平均	200

国庫短期証券入札予定

11月6日	3ヶ月
11月9日	6ヶ月
11月13日	3ヶ月
11月19日	1年
11月4日	10年
11月6日	物価連動
11月10日	30年
11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	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
物価連動債	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。



- 東京レボレートON (左軸上段 [%])
- 無担保コールON (右軸上段 [%])
- 無担保コール残高 (左軸下段 [億円])

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