



デイリーシグナル

2020年12月30日(水)

短期市場の推移

	12月24日	12月25日	12月28日	12月29日
加重平均金利	▲0.021	▲0.016	▲0.019	▲0.019
東京レボレート(TN)	▲0.085	▲0.085	▲0.081	▲0.079
無コール残	113,897	118,031	109,685	113,037
ON	67,119	72,503	66,007	70,244
その他	46,778	45,528	43,678	42,793
有コール残	23,118	21,963	23,723	21,680

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	▲0.080	0.001	▲0.033	▲0.102
T/N	-	-	-	▲0.077
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.020	0.000	▲0.017	▲0.081
2W	▲0.015	▲0.010	▲0.014	▲0.083
3W	-	-	-	▲0.089
1M	-	-	-	▲0.093
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.099
6M	-	-	-	▲0.115
1Y	-	-	-	▲0.144

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

1月4日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
菅首相 伊勢神宮参拝、年頭会見		(米)シカゴ連銀総裁、 アトランタ連銀総裁の講演	
-		(米)12月製造業PMI	
-		(欧)12月製造業PMI	

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▲0.040%の出合から始まった。四半期末越えの調達を控え、慎重な姿勢を見せる金融機関が多く、その後は主に▲0.040%~▲0.020%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▲0.014%の▲0.033%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.048 ~ ▲0.040	▲0.040 ~ ▲0.040	▲0.048 ~ ▲0.015

翌営業日のマーケット

年末越え要因の剥落により、出合水準は本日より大きく上昇すると予想。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	12月30日	1月4日	12月30日	1月4日	12月30日	1月4日
券	▲300	+3,600	▲300	+3,600	+5,000	+5,000
財政	▲3,200	▲20,500	▲3,200	▲20,500	+4,000	+4,000
過不足	▲3,500	▲16,900	▲3,500	▲16,900	+9,000	+9,000
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	▲4,100	+6,000	▲4,100	+6,000		
E T F 買入		+500		+500		
国債補充供給	+200	▲3,200	+200	▲3,200		
当座預金増減	▲4,100	▲13,700	▲4,100	▲13,700	+9,000	+9,000
当座預金残高	4,942,300	4,928,600	4,942,300	4,928,600	4,937,600	4,937,600
準備預金残高	4,330,000		4,330,000			
積み終了先	4,330,000		4,330,000			
超過準備	4,329,800		4,329,800			
非準備先残高	612,300		612,300			
準備預金進捗率	99.9%		99.9%			
平均	61.3%		61.3%			
乖離率	38.6%		38.6%			

12月30日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
国債補充供給(12/30~1/4)	3,191	3,191	▲0.350	▲0.350		
	17	17	▲0.350	▲0.350		

マネタリーベース (億円)
12月29日時点 6,179,900

所要	(億円)
今積期の所要準備額	3,581,400
1月4日以降の残り所要	
積数	200
平均	0

国庫短期証券入札予定

1月5日	3ヶ月	第962回
1月7日	6ヶ月	第963回
1月8日	3ヶ月	第964回
1月15日	3ヶ月	

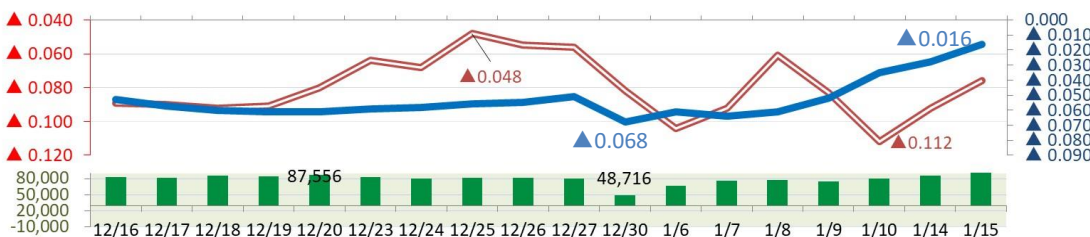
来月の国債買入オペ予定

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	2
1年超3年以下	3,000~6,000	5,000	5 14 20 25 27	12月21日	5
3年超5年以下	2,500~6,000	4,200	5 12 20 25 29	12月25日	5
5年超10年以下	2,500~6,000	4,200	5 12 20 25 29	12月25日	5
10年超25年以下	500~2,000	1,200	12 27	12月25日	2
25年超	0~500	300	14 29	12月25日	2
物価連動債	300	300	月2回程度	12月21日	2
変動利付債<偶数月>	500	500	月1回	12月7日	-

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