



デイリーシグナル

2021年12月10日(金)

短期市場の推移

	12月6日	12月7日	12月8日	12月9日
加重平均金利	▲0.035	▲0.028	▲0.022	▲0.015
東京レポレート(TN)	▲0.084	▲0.084	▲0.084	▲0.081
無コール残	139,967	144,323	142,243	148,090
ON	59,334	62,170	61,615	66,662
その他	80,633	82,153	80,628	81,428
有コール残	18,482	17,981	17,766	17,864

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	▲0.050	0.001	▲0.008	▲0.060
T/N	▲0.010	▲0.005	▲0.005	▲0.054
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.008	▲0.003	▲0.006	▲0.069
2W	-	-	-	▲0.082
3W	-	-	-	▲0.098
1M	▲0.007	0.150	0.045	▲0.102
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.111
6M	-	-	-	▲0.124
1Y	-	-	-	▲0.133

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13日の予定 (時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
8:50	10-12月期日銀短観 (大企業製造業DI)	19	-	-
8:50	10月コア機械受注 [前月比]	+1.5%	-	-
	-	-	-	-

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▲0.010%の合出から始まり、その後は主に▲0.015%~▲0.003%のレンジで推移した。今積み期最後の週末3日積みであり、様々な業態において調達ニーズが強く、本日の同加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.007%の▲0.008%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.010 ~ ▲0.008	▲0.010 ~ ▲0.008	▲0.010 ~ ▲0.003

翌営業日のマーケット

ビッドサイドの調達ニーズに大きな変化はなく、出合いの水準は横ばいを想定。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	12月10日		12月13日		12月14日	
券	▲1,000		▲1,100		▲1,000	
財政	▲27,700		+4,400		▲8,000	
過不足	▲28,700		+3,300		▲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	▲600		▲200			
社債等買入		+1,300				
国債補完供給	+100	▲300	+300			
当座預金増減	▲28,200		+3,400		▲9,000	
当座預金残高	5,230,900		5,234,300		5,225,300	
準備預金残高	4,696,900		主な需給要因			
積み終了先	4,696,900		国庫短期証券		源泉税揚げ	
超過準備	4,696,900		発行償還(3M)			
非準備先残高	534,000					
準備預金進捗率	100.0%					
平均	90.0%					
乖離率	10.0%					

12月10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(12/10~12/13)	267	267	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マネタリーベース [億円]
12月9日時点 6,494,600

所要	今積期の所要準備額
12月13日以降の残り所要	3,637,700
積数	0
平均	0

国庫短期証券入札予定

12月10日	3ヶ月(第1044回)
12月14日	6ヶ月(第1045回)
12月15日	1年(第1046回)
12月16日	3ヶ月(第1047回)

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8日	2
3年超5年以下	4500	4,500	3 15 21 24	12月3日	3
5年超10年以下	4250	4,250	8 15 21 24	12月8日	3
10年超25年以下	1500	1,500	3	12月3日	0
25年超	500	500	15	11月17日	1
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

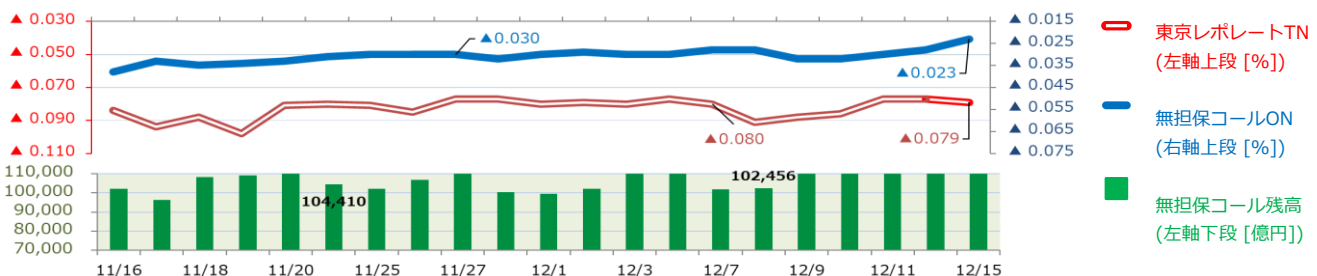
国債入札予定

12月16日	20年
12月27日	2年
1月5日	10年
1月7日	30年

1年前の市場推移

○2020年11積み期 [11月16日~12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