



## デイリーシグナル

2021年12月27日(月)

### 短期市場の推移

	12月21日	12月22日	12月23日	12月24日
加重平均金利	▲0.028	▲0.028	▲0.027	▲0.023
東京レボレート(TN)	▲0.087	▲0.086	▲0.074	▲0.079
無コール残	180,445	183,000	181,088	177,732
ON	102,062	102,817	100,485	96,759
その他	78,383	80,183	80,603	80,973
有コール残	17,801	17,593	18,472	17,665

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	▲0.060	0.001	▲0.021	▲0.076
T/N	▲0.015	▲0.010	▲0.014	▲0.078
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	▲0.005	▲0.084
2W	-	-	-	▲0.086
3W	-	-	-	▲0.090
1M	▲0.001	0.480	0.015	▲0.095
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.107
6M	-	-	-	▲0.119
1Y	-	-	-	▲0.130

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28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	1.16倍	-	-
8:30	11月失業率	+2.7%	-	-
8:50	11月鉱工業生産指数[前月比]	+22.8%	-	-

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▲0.020%の合出から始まり、その後は主に▲0.035%~▲0.010%のレンジで推移した。前営業日に引き続き、運用サイドの放出ニーズ減退が見られ、出合の水準は上昇し、本日の同加重平均金利(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
▲0.058 ~ ▲0.058		▲0.020 ~ ▲0.020	▲0.035 ~ ▲0.010

### 翌営業日のマーケット

ビッドサイドの調達ニーズは引き続き堅調で、出合いの水準は本日対比で横ばいと予想。

### 資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想
	12月27日	12月28日	12月27日	12月28日	12月29日
券	▲3,000	▲3,200			▲2,000
財政	+20,900	▲1,400			▲1,400
過不足	+17,900	▲4,600			▲3,400
金融調節	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド
国債買入		+9,500			
国債買戻先		+15,200			
国債補充供給		▲200	+200		
CP等買入	▲1,000		▲1,300		
新型コロナ対応金融支援特別	▲107,700	+124,700			
当座預金増減		+58,400		▲5,700	▲3,400
当座預金残高		5,462,700		5,457,000	5,453,600
準備預金残高		4,856,000	主な需給要因		
積み終了先		4,855,600			
超過準備		4,855,600			
非準備預金残高		606,700			
準備預金進捗率		99.9%			
平均		38.7%			
乖離率		61.2%			

### 12月27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
CP等買入(12/30~)	5,000	7,760	4,997	▲0.014	▲0.011	44.0
国債補充供給(12/27~12/28)	141	141	▲0.350	▲0.350		
	2	2	▲0.350	▲0.350		

マネタリーベース [億円]  
12月24日時点 6,666,200

所要	[億円]
今積期の所要準備額	3,769,300
12月28日以降の残り所要	
積数	1,800
平均	100

### 国庫短期証券入札予定

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

1月5日	10年
1月7日	30年
1月12日	5年
1月14日	20年

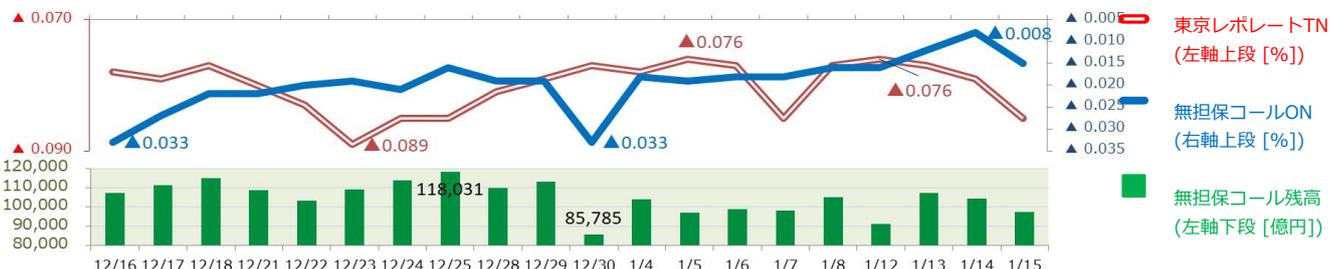
### 今月の国債買入オペ予定

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