上田八木短資

デイリーシグナル

2021年12月29日(水)

短期市場の推移 [億円] [%]

	12月23日	12月24日	12月27日	12月28日
加重平均金利	▲0.027	▲0.023	▲0.021	▲0.018
東京レポレート(TN)	▲0.074	▲0.079	▲0.078	▲0.081
無コール残	181,088	177,732	164,741	166,178
ON	100,485	96,759	83,328	85,055
その他	80,603	80,973	81,413	81,123
有コール残	18,472	17,665	17,698	18,504

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。

12月30日の予定 (時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
	-		22:30	(米)新規失業保険申請件数 [前週分]	-
	-			-	
	-			-	

経済指標及び予想値は株式会社フィスコ提供

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	▲0.060	0.001	▲0.016	▲0.083
T/N	▲0.030	▲0.005	▲0.020	▲0.083
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.010	▲0.003	▲0.007	▲0.084
2W	▲0.040	0.001	▲0.024	▲0.086
3W	-	-	▲0.005	▲0.091
1M	▲0.028	▲0.002	▲0.009	▲0.094
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.108
6M	-	-	-	▲0.119
1Y	-	-	-	▲0.129

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

本日の市況

本日の無担保コールON物は▲0.008%の出合から始まり、その後は主に▲0.030%～▲0.005%のレンジで推移した。地銀を中心に調達意欲が強く、本日の同加重平均金利（速報）は前営業日対比+0.002%の▲0.016%となった。

[%]

都銀・信託	証券	地銀
▲ 0.040 ～ ▲ 0.040	- ～ -	▲ 0.030 ～ ▲ 0.005

翌営業日のマーケット

月末により調達を控える先もあるが、調達を行う先は引き続き積極的に動く見込み。出合いの水準は本日対比横ばいからやや上昇と予想。

資金需給 [億円]

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	12月29日		12月30日		1月4日	
券	▲2,200		▲300		+2,000	
財政	▲5,800		▲6,400		▲22,000	
過不足	▲8,000		▲6,700		▲20,000	
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
国債買現先			▲15,200			
国債補完供給	+200	▲200	+200			
CP等買入			▲2,300	+5,000		
当座預金増減	▲8,000		▲19,000		▲20,000	
当座預金残高	5,449,100		5,430,100		5,410,100	
準備預金残高	4,858,700		主な需給要因			
積み終了先	4,858,300				国債発行・償還	
超過準備	4,858,300				(2Y)	
非準預先残高	590,400					
準備預金進捗率	99.9%					
平均	45.2%					
乖離率	54.7%					

12月29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(12/29～12/30)	226	226	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マネタリーベース [億円]

12月28日時点	6,725,100

所要 [億円]

今積期の所要準備額	3,769,300
12月30日以降の残り所要	
積数	1,100
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	1年

国債入札予定

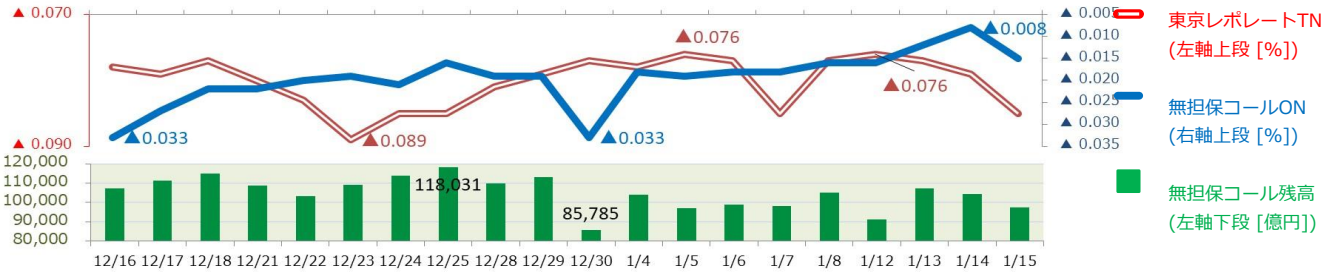
1月5日	10年
1月7日	30年
1月12日	5年
1月14日	20年

今月の国債買入オペ予定 [億円]

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