



デイリーシグナル

2021年12月30日(木)

短期市場の推移

	12月24日	12月27日	12月28日	12月29日
加重平均金利	▲0.023	▲0.021	▲0.018	▲0.016
東京レポレート(TN)	▲0.079	▲0.078	▲0.081	▲0.083
無コール残	177,732	164,741	166,178	139,532
ON	96,759	83,328	85,055	58,954
その他	80,973	81,413	81,123	80,578
有コール残	17,665	17,698	18,504	17,796

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	▲0.150	0.001	▲0.018	▲0.080
T/N	▲0.030	▲0.010	▲0.025	▲0.079
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	▲0.008	▲0.080
2W	▲0.045	▲0.017	▲0.037	▲0.084
3W	-	-	-	▲0.088
1M	-	-	▲0.010	▲0.093
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.107
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

1月4日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	(米)ISM製造業指数[12月]	-
-	-	-	-
-	-	-	-

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

2021年最終営業日の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。ビッドサイドは年末初物で調達を控える先もあったものの、積極的に調達に動く先も多く、本日の同加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.002%の▲0.018%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.030 ~ ▲0.030	▲0.040 ~ ▲0.040	▲0.030 ~ ▲0.001

翌営業日のマーケット

オファービッドとともに年末で控えていた先が戻ってくることも想定され、出合いの水準は横ばい圏での推移を予想する。

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	1月4日	1月5日	1月5日
券	▲200	+2,800	+2,800	+3,000	+3,000
財政	▲5,400	▲24,000	▲24,000	▲1,000	▲1,000
過不足	▲5,600	▲21,200	▲21,200	+2,000	+2,000
金融調節	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド
国債買現先	▲15,200				
CP等買入	▲2,300	+5,000	▲300		
国債補完供給	+200	▲700	+700		
共通担保(全)				▲5,600	
当座預金増減	▲18,600	▲20,800	▲20,800	▲3,600	▲3,600
当座預金残高	5,430,500	5,409,700	5,409,700	5,406,100	5,406,100
準備預金残高	4,817,100				
積み終了先	4,817,100				
超過準備	4,816,900				
非準備先残高	613,400				
準備預金進捗率	99.9%				
平均	61.3%				
乖離率	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
国債補完供給(12/30~1/4)	664	664	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マナリーベース (億円)
12月29日時点 6,719,200

所要	(億円)
今積期の所要準備額	3,769,300
1月4日以降の残り所要	
積数	100
平均	0

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
1月5日	10年
1月7日	30年
1月12日	5年
1月14日	20年

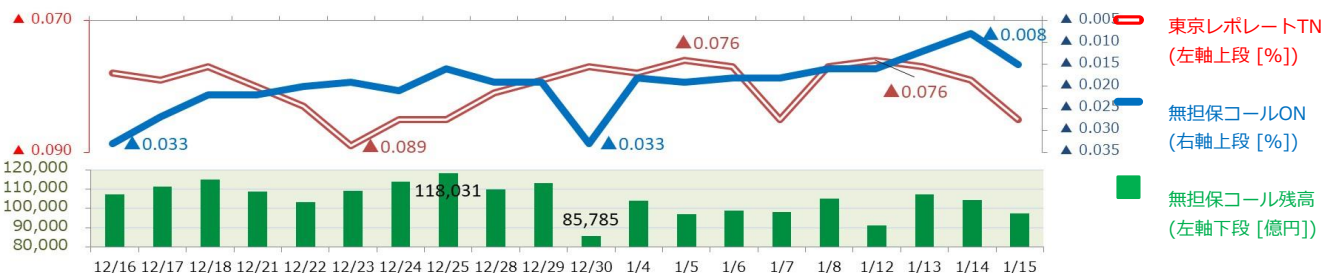
来月の国債買入オペ予定

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	1500	1,500	月1回	12月8日	1
1年超3年以下	4500	4,500	6 11 17 20	12月21日	4
3年超5年以下	4500	4,500	6 17 20 26	12月24日	4
5年超10年以下	4250	4,250	11 17 20 26	12月24日	4
10年超25年以下	1500	1,500	6	12月3日	1
25年超	500	500	17	12月15日	1
物価連動債	600	600	月1回	12月24日	1
変動利付債<四半期>	300	300	四半期に1回	10月13日	1

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