



## デイリーシグナル

2022年1月4日(火)

### 短期市場の推移

	12月27日	12月28日	12月29日	12月30日
加重平均金利	▲0.021	▲0.018	▲0.016	▲0.018
東京レボレート(TN)	▲0.078	▲0.081	▲0.083	▲0.079
無コール残	164,741	166,178	139,532	110,014
ON	83,328	85,055	58,954	62,886
その他	81,413	81,123	80,578	47,128
有コール残	17,698	18,504	17,796	15,928

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	▲0.016	▲0.077
T/N	▲0.040	▲0.008	▲0.020	▲0.076
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.010	▲0.001	▲0.008	▲0.077
2W	▲0.045	0.100	▲0.021	▲0.081
3W	▲0.015	0.150	0.024	▲0.086
1M	▲0.018	0.200	▲0.001	▲0.089
2M	-	-	0.001	-
3M	-	-	-	▲0.105
6M	-	-	-	▲0.119
1Y	-	-	-	▲0.129

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5日の予定 (時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
8:50	12月マネタリーベース (日銀)		0:00	(米)12月ISM製造業景況指数	60.5
	-		22:15	(米)12月ADP全米雇用報告	41.8万人
	-			(米)FOMC議事録 (12月14日~15日分)	

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

2022年最初の営業日である本日の無担保コールON物は、▲0.010%の出合から始まり出合の中心は▲0.010%~▲0.005%であった。ビッドサイドで地銀を中心に積極的な動きが見られ、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
▲0.038 ~ ▲0.038	- ~ -	▲0.010 ~ ▲0.003

### 翌営業日のマーケット

オファーサイド、ビッドサイド共に大きな動きはないと思われ、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
	1月4日	1月5日	1月6日
券	+2,700	+2,900	+2,000
財政	▲22,500	▲5,300	▲57,000
過不足	▲19,800	▲2,400	▲55,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
CP等買入	▲300		
国債補充供給	+700	+100	
共通担保(全)	▲100	▲5,600	+3,800
当座預金増減	▲19,500	▲4,100	▲55,000
当座預金残高	5,411,000	5,406,900	5,351,900
準備預金残高	4,806,000	主な需給要因	
積み終了先	4,806,000	国庫短期証券発行・償還(3M)	
超過準備	4,806,000	国債発行(10年)	
非準備先残高	605,000	法人税・消費税・保険	
準備預金進捗率	99.9%	揚げ	
平均	64.5%		
乖離率	35.4%		

### 1月4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
国債補充供給(1/4~1/5)	108	108	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

共通担保(全店)(1/5~1/18)	20,000	3,750	3,750
--------------------	--------	-------	-------

米ドル資金供給(1/6~1/13)	0	0	0.330	0.330
-------------------	---	---	-------	-------

マネタリーベース [億円]	所要 [億円]
12月30日時点 6,700,700	今積期の所要準備額 3,769,300
	1月5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	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

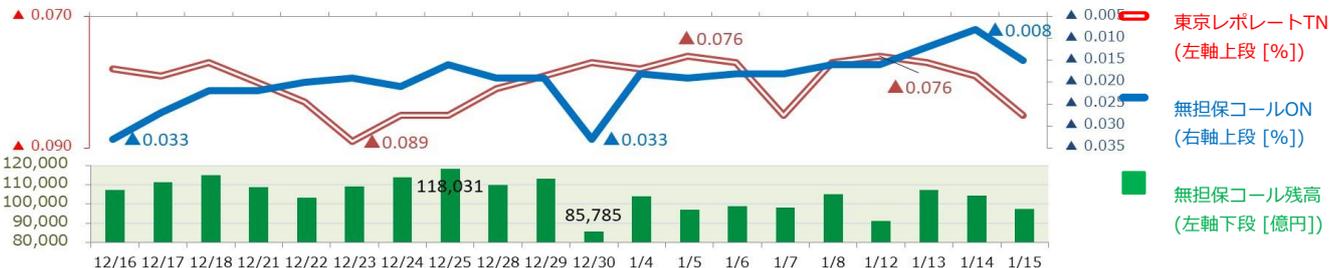
### 今月の国債買入オペ予定

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	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	-
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