上田八木短資

デイリーシグナル

2022年1月5日(水)

短期市場の推移 [億円] [%]

	12月28日	12月29日	12月30日	1月4日
加重平均金利	▲0.018	▲0.016	▲0.018	▲0.016
東京レポレート(TN)	▲0.081	▲0.083	▲0.079	▲0.076
無コール残	166,178	139,532	110,014	132,664
ON	85,055	58,954	62,886	68,936
その他	81,123	80,578	47,128	63,728
有コール残	18,504	17,796	15,928	16,821

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。

1月6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]	-
	-		22:30	(米)11月貿易収支	-693億米ドル
	-			(米)12月ISM非製造業指数	-

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	▲0.065	0.001	▲0.012	▲0.072
T/N	-	-	▲0.030	▲0.069
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.008	▲0.005	▲0.007	▲0.072
2W	▲0.040	▲0.005	▲0.032	▲0.077
3W	-	-	-	▲0.082
1M	▲0.015	▲0.005	▲0.009	▲0.087
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.105
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▲0.025%～▲0.005%のレンジで推移した。ビッドサイドでは様々な業態で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+0.004%の▲0.012%となった。

[%]

都銀・信託	証券	地銀
▲ 0.025 ～ ▲ 0.025	- ～ -	▲ 0.010 ～ ▲ 0.003

翌営業日のマーケット

オファーサイド、ビッドサイド共に特段の変化はなく、出合いの水準は横ばい圏での推移を予想。

資金需給 [億円]

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	1月5日		1月6日		1月7日	
券	+3,200		+1,900		+2,000	
財政	▲4,200		▲61,800		+3,000	
過不足	▲1,000		▲59,900		+5,000	
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
共通担保（全）	▲5,600	+3,800				
国債補完供給	+100	▲200	+200			
CP等買入			▲200			
当座預金増減	▲2,900		▲59,900		+5,000	
当座預金残高	5,408,100		5,348,200		5,353,200	
準備預金残高	4,801,200		主な需給要因			
積み終了先	4,801,200		国庫短期証券発行・償還(3M)			
超過準備	4,801,200		国債発行（10年）			
非準預先残高	606,900		法人税・消費税・保険揚げ			
準備預金進捗率	99.9%					
平均	67.7%					
乖離率	32.2%					

国債補完供給(1/5～1/6)
200 200 ▲0.350 ▲0.350
0 0

1月5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

マネタリーベース [億円]

1月4日時点	6,678,500

所要 [億円]

今積期の所要準備額	3,769,300
1月6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6日	6ヶ月(第1049回)
1月7日	3ヶ月(第1050回)
1月14日	3ヶ月
1月19日	1年

国債入札予定

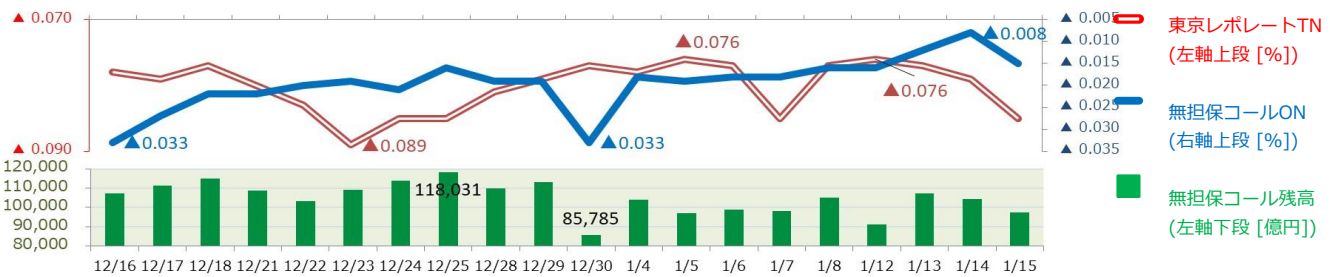
1月7日	30年
1月12日	5年
1月14日	20年
1月25日	40年

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	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