



デイリーシグナル

2022年12月23日(金)

短期市場の推移

	12月19日	12月20日	12月21日	12月22日
加重平均金利	▲0.071	▲0.068	▲0.067	▲0.065
東京レボレート(TN)	▲0.091	▲0.090	▲0.129	▲0.118
無コール残	127,851	131,220	137,446	142,924
ON	63,049	64,669	68,815	73,694
その他	64,802	66,551	68,631	69,230
有コール残	30,357	30,743	30,569	30,606

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	▲0.087	0.001	▲0.062	▲0.094
T/N	-	-	-	▲0.123
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.070	▲0.060	▲0.067	▲0.216
2W	-	-	-	▲0.194
3W	-	-	▲0.034	▲0.180
1M	-	-	-	▲0.176
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.146
6M	-	-	-	▲0.129
1Y	-	-	-	▲0.105

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26日の予定 (時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
特になし			(米) 休場		
-			(欧) 休場		
-			-		

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▲0.055%の出合から始まり、その後は主に▲0.065%~▲0.055%の水準で取引された。ビッドサイドの調達意欲は昨日よりも強まり、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.003%の▲0.062%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.080 ~ ▲0.080	▲0.068 ~ ▲0.068	▲0.065 ~ ▲0.055

翌営業日のマーケット

調達意欲はやや減退し、出合の水準は小幅低下と予想。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	12月23日	12月26日	12月26日	12月27日	12月27日	12月27日
債券	▲2,500	▲2,700	▲2,700	▲2,000	▲2,000	▲2,000
財政	+9,000	+4,800	+4,800	▲3,000	▲3,000	▲3,000
過不足	+6,500	+2,100	+2,100	▲5,000	▲5,000	▲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
国債買入		+13,300				
CP等買入	▲1,000		▲900			
社債等買入	▲100					
国債補完供給	+33,000	▲30,600	+30,600			
貸出増加支援	▲3,200					
新型コロナ対応金融支援特別	▲11,900	+8,400				
当座預金増減	+14,400	+31,800	+31,800	▲5,000	▲5,000	▲5,000
当座預金残高	5,018,200	5,050,000	5,050,000	5,045,000	5,045,000	5,045,000
準備預金残高	4,383,500	主な需給要因				
積み終了先	4,381,800					
超過準備	4,381,500					
非準備先残高	634,700					
準備預金進捗率	99.7%					
平均	32.3%					
乖離率	67.5%					

12月23日のオペ結果

オペ種類 オファー 応札 落札 足切 平均 按分

国債買入(固定利回り方式)(12/26~)	
5~10年	0 0
5~10年	0 0
国債補完供給(12/23~12/26)	
	30,848 30,848 ▲0.350 ▲0.350
	0 0

マネタリーベース [億円]
12月22日時点 6,291,400

所要		所要
今積期の所要準備額	3,904,800	
12月26日以降の残り所要		
積数	10,000	
平均	500	

国債短期証券入札予定

1月5日	3ヶ月
1月6日	6ヶ月
1月10日	3ヶ月
1月13日	3ヶ月

国債入札予定

12月27日	2年
1月5日	10年
1月11日	30年
1月13日	5年

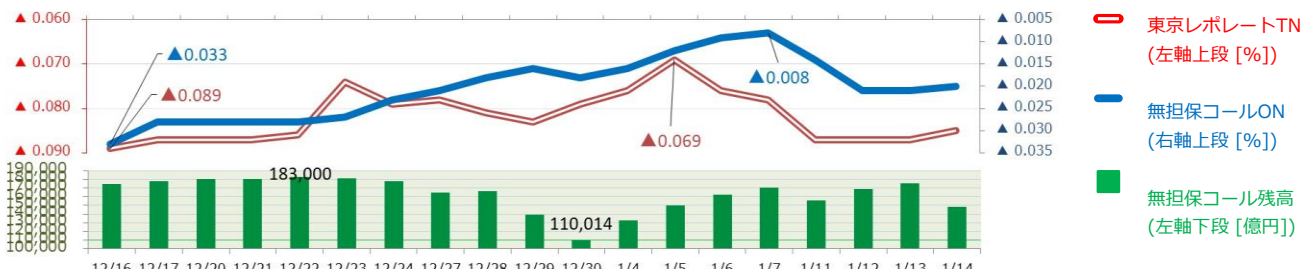
今月の国債買入オペ予定

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2日	0
1年超3年以下	4750	1,000	2 7 14 19	12月20日	0
3年超5年以下	4750	6,500	2 14 19 26	12月22日	1
5年超10年以下	5500	6,750	7 14 19 26	12月22日	1
10年超25年以下	2500	1,000	7 19 26	12月20日	1
25年超	1000	1,000	2 14 26	12月14日	1
物価連動債	600	600	月1回	11月14日	1
変動利付債<四半期>	300	300	四半期に1回	10月17日	-

1年前の市場推移

○2021年12月積み期 [12月16日~1月14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