



デイリーシグナル

2024年12月11日(水)

	12月5日	12月6日	12月9日	12月10日
加重平均金利	0.232	0.227	0.227	0.227
東京レポレート(TN)	0.240	0.244	0.240	0.247
無コール残	82,052	79,987	80,505	81,308
ON	33,961	30,596	30,784	31,317
その他	48,091	49,391	49,721	49,991
有コール残	39,218	39,384	39,008	38,710

日本	予想	海外	予想
-	-	(米) 生産者物価 (11月)	-
-	-	-	-
-	-	-	-

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 [%]

	最低	最高	平均	レポ市場 東京レポレート
O/N	0.220	0.275	0.227	0.248
T/N	-	-	-	0.248
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	0.227	0.229
2W	-	-	0.300	0.238
3W	-	-	-	0.247
1M	-	-	-	0.254
2M	-	-	-	-
3M	0.530	0.580	0.535	0.349
6M	-	-	-	0.391
1Y	-	-	-	0.480

本日の市況

無担保コールON物は0.227%の出合から始まり、その後は主に同水準を中心に取引された。ビットサイドの資金調達意欲は引き続き底堅く、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比横ばいの0.227%となった。

都銀・信託	証券	地銀
- ~ -	- ~ -	0.226 ~ 0.227

翌営業日のマーケット

ビットサイドの資金調達意欲は引き続き旺盛であるため、出合の水準は本日対比横ばい圏を予想する。

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

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	12月11日		12月12日		12月13日	
券	▲1,500		▲2,800		▲1,000	
財政	▲27,600		+9,100		+74,000	
過不足	▲29,100		+6,300		+73,000	
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(全店)	▲8,000	+8,000				
社債等買入			▲200			
国債補完供給	+3,400	▲3,100	+3,100			
貸出増加支援					▲54,700	+33,800
当座預金増減	▲28,800		+9,200		+52,100	
当座預金残高	5,249,600		5,258,800		5,310,900	
準備預金残高	4,709,600		主な需給要因			
積み終了先	4,709,600		源泉税揚げ		年金定時払い	
超過準備	4,709,600		流動性供給			
非準備先残高	540,000					
準備預金進捗率	99.9%					
平均	86.7%					
乖離率	13.2%					

12月11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(12/11~12/12)	3,167	3,167	▲0.050	▲0.050		
	2	2	▲0.050	▲0.050		

マネタリーベース [億円]	所要 [億円]
12月10日時点 6,534,600	今積期の所要準備額 3,921,500
	12月12日以降の残り所要
	積数 100
	平均 0

12月13日	3ヶ月(第1275回)
12月18日	1年(第1276回)
12月20日	3ヶ月
1月7日	3ヶ月

12月17日	20年
12月26日	2年
1月7日	10年
1月9日	30年

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	4				12月4日	0
1年超3年以下	3250	3,250	4	9	13	20	12月9日	2
3年超5年以下	3250	3,250	4	13	20	25	12月4日	3
5年超10年以下	3750	3,750	9	13	20	25	12月9日	3
10年超25年以下	1500	1,500	4	13	20		12月4日	2
25年超	750	750	9	25			12月9日	1
物価連動債	600	600	25				11月28日	1
変動利付債	-	300					2023/4/14	-

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