



デイリーシグナル

2024年12月24日(火)

短期市場の推移

	12月18日	12月19日	12月20日	12月23日
加重平均金利	0.226	0.227	0.227	0.227
東京レポレート(TN)	0.245	0.251	0.242	0.239
無コール残	81,470	80,958	77,261	74,736
ON	32,609	33,307	33,750	31,370
その他	48,861	47,651	43,511	43,366
有コール残	39,007	38,652	41,352	40,233

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	0.219	0.228	0.227	0.244	
T/N	-	-	-	0.238	
S/N	-	-	-	-	
1W	-	-	-	0.203	
2W	0.295	0.320	0.303	0.209	
3W	-	-	-	0.218	
1M	-	-	-	0.223	
2M	-	-	-	-	
3M	0.460	0.580	0.500	0.324	
6M	-	-	-	0.396	
1Y	-	-	-	0.492	

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

12月25日の予定 (時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
12:30	植田日銀総裁の講演 (日本経済団体連合会審議委員会)		-	
	-		-	
	-		-	

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
- ~ -	0.227 ~ 0.227	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。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	12月24日	12月25日	12月24日	12月25日	12月24日	12月25日
券	▲2,900	▲2,600	▲2,900	▲2,600	▲2,000	▲2,000
財政	▲10,300	+3,400	▲10,300	+3,400	▲10,300	+3,400
過不足	▲13,200	+800	▲13,200	+800	▲12,300	+4,000
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		
CP等買入	▲100		▲200			
社債等買入			▲500			
国債補完供給	+7,700	▲6,300	+6,300			
当座預金増減	▲11,900	+6,400	▲11,900	+6,400	▲11,900	+6,400
当座預金残高	5,323,200	5,329,600	5,323,200	5,329,600	5,323,200	5,329,600
準備預金残高	4,818,200		4,818,200		4,818,200	
積み終了先	4,816,300		4,816,300		4,816,300	
超過準備	4,816,300		4,816,300		4,816,300	
非準備先残高	505,000		505,000		505,000	
準備預金進捗率	99.7%		99.7%		99.7%	
平均	29.0%		29.0%		29.0%	
乖離率	70.6%		70.6%		70.6%	

12月24日のオペ結果

オベ種類 オファー 応札 落札 足切 平均 按分

米ドル資金供給(12/27~1/9)	0	0	4,580	4,580		
国債補完供給(12/24~12/25)	6,393	6,393	▲0.050	▲0.050		
共通担保(全店)(12/25~1/8)	8,000	13,867	8,005		57.7	

マネタリーベース [億円]
12月23日時点 6,612,500

所要	所要準備額
今積期の所要準備額	4,063,800
12月25日以降の残り所要	
積数	13,800
平均	600

国債短期証券入札予定

1月7日	3ヶ月
1月9日	6ヶ月
1月10日	3ヶ月
1月16日	1年

国債入札予定

12月26日	2年
1月7日	10年
1月9日	30年
1月14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	4		12月4日 0
1年超3年以下	3250	3,250	4 9 13 20		12月20日 0
3年超5年以下	3250	3,250	4 13 20 25		12月20日 1
5年超10年以下	3750	3,750	9 13 20 25		12月20日 1
10年超25年以下	1500	1,500	4 13 20		12月20日 0
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	-		4月14日 -

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