

### 短期市場の推移

	1月7日	1月8日	1月9日	1月10日
加重平均金利	▲0.064	▲0.061	▲0.052	▲0.035
東京レポレート(ON)	▲0.092	▲0.061	▲0.083	▲0.112
無コール残	76,338	77,028	74,375	80,044
ON	50,963	50,068	46,515	50,619
その他	25,375	26,960	27,860	29,425
有コール残	22,602	25,585	20,295	20,686

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15日の予定(時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
9:30頃	【挨拶】黒田総裁(支店長会議)	21:00	(米)MBA住宅ローン申請指数[前週比]
10:00	営業毎旬報告(1月10日現在)	22:30	(米)1月NY連銀製造業景気指数
14:00	地域経済報告(1月)		(米)ハーフジュブク

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	▲0.070	0.001	▲0.028	▲0.092
T/N	-	-	-	▲0.085
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	0.002	▲0.081
2W	-	-	-	▲0.082
3W	0.000	0.001	0.001	▲0.084
1M	-	-	▲0.030	▲0.090
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.105
6M	-	-	-	▲0.143
1Y	-	-	-	▲0.161

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

無担保コールON物は▲0.040%の出合から始まった。その後は主に▲0.040%~▲0.015%の水準で取引された。先週末に引き続き、ビッドサイドの調達意欲は強く、同加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.007%の▲0.028%と4営業日連続で上昇した。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.040 ~ ▲0.030	▲0.025 ~ ▲0.015	▲0.040 ~ ▲0.015

### 翌営業日のマーケット

積み最終日となる明日は、ビッドサイドの動向に大きな変化はなく、引き続き堅調な地合を予想する。

### 資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	1月14日	1月15日	1月15日	1月16日	1月16日	1月17日
券	+3,100	+2,600	+2,600	+1,000	+1,000	+1,000
財政	+2,100	▲5,500	▲5,500	▲18,000	▲18,000	▲18,000
過不足	+5,200	▲2,900	▲2,900	▲17,000	▲17,000	▲17,000
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	+11,900	+1,500	+1,500			
共通担保(全店)	▲6,000	+5,900				
CP等買入	▲400		▲300			
国債補完供給	+300	▲200	+200			
当座預金増減	+16,700	▲1,500	▲1,500	▲17,000	▲17,000	▲17,000
当座預金残高	3,982,400	3,980,900	3,980,900	3,963,900	3,963,900	3,963,900
準備預金残高	3,483,800					
積み終了先	3,483,700					
超過準備	3,483,600					
非準備預金残高	498,600					
準備預金進捗率	99.9%					
平均	96.8%					
乖離率	3.1%					

### 1月14日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	接分
国債買入(1/15~)						
10~25年	1,000	3,723	1,007	0.011	0.012	22.4
25年~	300	1,561	303	0.008	0.008	90.6
米ドル資金供給(1/16~1/24)						
		0	0	2.050	2.050	
国債補完供給(1/14~1/15)						
		213	213	▲0.350	▲0.350	

### 国庫短期証券入札予定

1月16日	1年	第882回
1月17日	3ヶ月	第883回
1月24日	3ヶ月	
1月31日	3ヶ月	
国債入札予定		
1月15日	5年	
1月17日	20年	
1月28日	40年	
1月30日	2年	

### 今月の国債買入オペ予定

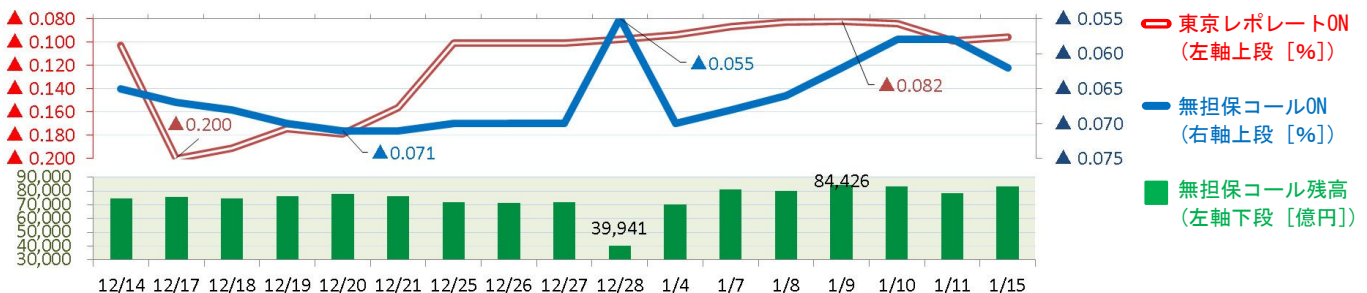
オペ種類	一回当たりオファー金額	直近オファー額	オファー予定日	直近日	残り回数
1年以下	100~1,000 程度	500	月2回程度	12月25日	2
1年超3年以下	3,000~5,500 程度	4,200			
3年超5年以下	2,000~4,500 程度	3,400	6 10 20 29	1月10日	2
5年超10年以下	2,000~5,000 程度	3,500	10 16 23 29	1月10日	3
10年超25年以下	500~1,500 程度	1,000			
25年超	0~500 程度	300	6 14 23	1月14日	1
物価連動債	300 程度	300	月2回程度	1月10日	1
変動利付債<偶数月>	1,000 程度	1,000	-	12月9日	-

マナタリーベース [億円]  
1月10日時点 5,121,100

所要 [億円]  
今積期の所要準備額 3,233,900  
1月15日以降の残り所要積数 100  
平均 100

### 1年前の市場推移 ○2018年12月積み期 [12月14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。