



短期市場の推移

[億円] [%]

	1月5日	1月6日	1月7日	1月8日
加重平均金利	▲0.019	▲0.018	▲0.018	▲0.016
東京レポレート(TN)	▲0.076	▲0.077	▲0.085	▲0.077
無コール残	97,122	98,967	98,186	105,110
ON	62,669	62,814	60,703	67,977
その他	34,453	36,153	37,483	37,133
有コール残	21,288	21,360	19,772	20,696

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)			レポレート
	最低	最高	平均	
O/N	▲0.050	0.001	▲0.016	▲0.077
T/N	▲0.010	▲0.001	▲0.003	▲0.076
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.015	▲0.010	▲0.012	▲0.080
2W	▲0.013	0.010	▲0.004	▲0.083
3W	-	-	-	▲0.088
1M	-	-	▲0.040	▲0.092
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.100
6M	-	-	-	▲0.113
1Y	-	-	-	▲0.143

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

資金需給

[億円]

	日銀速報	日銀予想	当社需給予想
	1月12日	1月13日	1月14日
券	+2,300	+2,700	+2,000
財政	▲34,500	+100	▲33,000
過不足	▲32,200	+2,800	▲31,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国債買入			▲11,500
共通担保(全店)		▲4,700	+4,100
CP等買入	▲500		
社債等買入		+3,000	
E T F買入		+100	
国債補充供給	+200	▲400	+400
当座預金増減	▲32,900	+17,200	▲31,000
当座預金残高	4,862,100	4,879,300	4,848,300
準備預金残高	4,318,300		
積み終了先	4,318,300		
超過準備	4,318,300		
非準備先残高	543,800		
準備預金進捗率	100.0%		
平均	90.3%		
乖離率	9.7%		

1月12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

国債買入(1/13~)

～1年	1,500	1,758	1,501	▲0.015	0.001	44.7
3～5年	4,200	7,132	4,202	▲0.004	0.001	65.5
5～10年	4,200	5,842	4,204	0.001	0.003	94.4
10～25年	1,200	5,765	1,206	0.008	0.009	31.0

米ドル資金供給(1/14～1/22)

0 0 0.340 0.340

米ドル資金供給(1/14～4/8)

0 0 0.330 0.330

国債補充供給(1/12～1/13)

341 341 ▲0.350 ▲0.350

0 0

共通担保(全店)(1/13～1/28)

20,000 4,051 4,051

マネタリーベース [億円]

1月8日時点 6,115,400

所要

今積期の所要準備額 3,592,300

1月13日以降の残り所要

積数 0

平均 0

国庫短期証券入札予定

1月15日	3ヶ月	第965回
1月19日	1年	第966回
1月20日	6ヶ月	
1月22日	3ヶ月	

国債入札予定

1月13日	5年
1月19日	20年
1月26日	40年
1月28日	2年

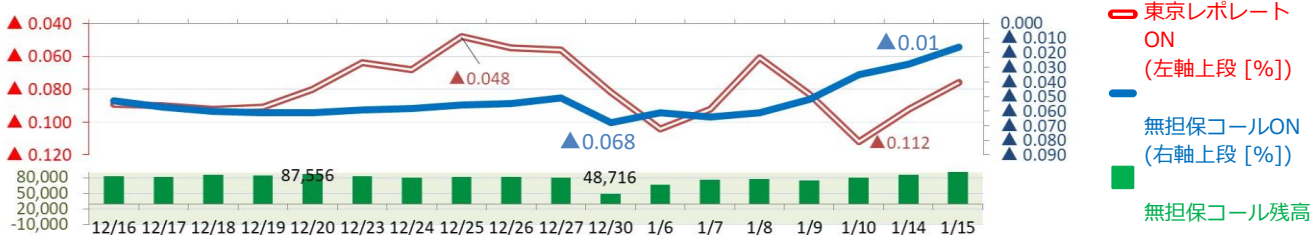
今月の国債買入オペ予定

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	1,000～2,000	1,500	2月2回程度	1月12日	1
1年超3年以下	3,000～6,000	4,500	5 14 20 25 27	1月5日	4
3年超5年以下	2,500～6,000	4,200	5 12 20 25 29	1月12日	3
5年超10年以下	2,500～6,000	4,200	5 12 20 25 29	1月12日	3
10年超25年以下	500～2,000	1,200	12 27	1月12日	1
25年超	0～500	300	14 29	12月25日	2
物価連動債	300	300	月2回程度	12月21日	2
変動利付債<偶数月>	500	500	月1回	12月7日	-

1年前の市場推移

○2019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