



短期市場の推移

	1月7日	1月8日	1月12日	1月13日
加重平均金利	▲0.018	▲0.016	▲0.016	▲0.012
東京レポレート(TN)	▲0.085	▲0.077	▲0.076	▲0.077
無コール残	98,186	105,110	91,294	107,082
ON	60,703	67,977	54,441	66,169
その他	37,483	37,133	36,853	40,913
有コール残	19,772	20,696	20,284	20,192

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	▲0.050	0.001	▲0.008	▲0.074
T/N	▲0.010	▲0.001	▲0.003	▲0.079
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	-	▲0.080
2W	▲0.020	0.010	▲0.006	▲0.083
3W	-	-	-	▲0.088
1M	▲0.025	0.001	▲0.015	▲0.092
2M	-	-	-	-
3M	-	-	0.080	▲0.099
6M	-	-	-	▲0.114
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

		日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
		1月14日		1月15日		1月18日	
券		+1,700		+2,000		+2,000	
財政		▲27,600		+2,200		▲14,000	
過不足		▲25,900		+4,200		▲12,000	
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
国庫短期証券買入			+15,000				
国債買入					+5,100		
CP等買入		▲300		▲1,400			
E T F 買入			+500		+100		
被災地金融機関支援					+200		
国債補完供給		+300	▲300	+300			
当座預金増減		▲10,700		+8,500		▲12,000	
当座預金残高		4,867,400		4,875,900		4,863,900	
準備預金残高		4,321,400		主な需給要因			
積み終了先		4,321,400					
超過準備		4,321,400		国債発行・償還 (個人)			
非準備先残高		546,000					
準備預金進捗率		100.0%					
平均		96.8%		国庫短期証券 発行・償還(3M)			
乖離率		3.2%					

1月14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(1/15~)						
1~3年	4,500	10,497	4,503	0.002	0.003	79.9
25年~	300	1,721	303	0.008	0.008	84.1
物価連動	300	1,946	301	▲0.230	▲0.248	66.4
CP等買入(1/19~)						
	6,000	11,638	5,993	▲0.030	▲0.026	10.9
国債補完供給(1/14~1/15)						
	257	257	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マネタリーベース [億円]

1月13日時点 6,093,300

所要

今積期の所要準備額		3,592,300
1月15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 第967回
1月22日	3ヶ月

国債入札予定

1月19日	20年
1月26日	40年
1月28日	2年
2月2日	10年

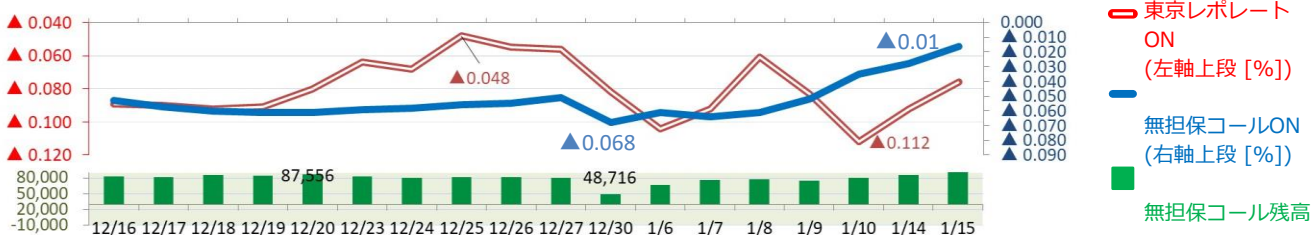
今月の国債買入オペ予定

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

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