



短期市場の推移

[億円] [%]

	12月29日	12月30日	1月4日	1月5日
加重平均金利	▲0.016	▲0.018	▲0.016	▲0.012
東京レボレート(TN)	▲0.083	▲0.079	▲0.076	▲0.069
無コール残	139,532	110,014	132,664	149,606
ON	58,954	62,886	68,936	79,293
その他	80,578	47,128	63,728	70,313
有コール残	17,796	15,928	16,821	17,673

加重平均金利、コール残高は日銀、東京レボ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)			レボ市場
	最低	最高	平均	東京レボレート
O/N	▲0.055	0.001	▲0.009	▲0.064
T/N	▲0.005	▲0.003	▲0.005	▲0.076
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.009	▲0.001	▲0.005	▲0.076
2W	▲0.015	▲0.008	▲0.010	▲0.078
3W	-	-	-	▲0.082
1M	-	-	0.150	▲0.088
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.105
6M	-	-	-	▲0.119
1Y	-	-	-	▲0.129

無担保コール(速報)は日銀、東京レボレートは日本証券業協会公表

1月7日の予定(時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
	-		22:30	(米)12月失業率	4.1%
	-			-	
	-			-	

経済指標及び予想値は株式会社フィスコ提供

本日の市況

本日の無担保コールON物は、▲0.008%の出合から始まり、その後は主に▲0.015%~▲0.003%のレンジで推移した。ビッドサイドで都銀業態を中心に積極的な動きが見られ、本日の同加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.003%の▲0.009%(速報)となった。本日の加重平均金利は2021年12月13日以来の水準となる。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.015 ~ ▲0.015	▲0.005 ~ ▲0.005	▲0.010 ~ ▲0.003

翌営業日のマーケット

オファーサイド、ビッドサイド共に大きな動きはないと思われ、出合いの水準は横ばい圏での推移を予想する。

資金需給

[億円]

	日銀速報	日銀予想	当社需給予想
	1月6日	1月7日	1月11日
券	+2,100	+3,100	+3,000
財政	▲62,800	▲4,100	▲2,500
過不足	▲60,700	▲1,000	+500
金融調節	エンド	スタート	エンド
国債買入			+10,600
国債買現先			+20,000
CP等買入			
国債補完供給	▲200	▲300	
	+200	+200	
当座預金増減	▲60,900	+29,500	+500
当座預金残高	5,347,200	5,376,700	5,377,200
準備預金残高	4,768,000	主な需給要因	
積み終了先	4,768,000	国庫短期証券発行・償還(3M・6M)	
超過準備	4,768,000	国債発行(30年)	
非準備先残高	579,200		
準備預金進捗率	99.9%		
平均	71.0%		
乖離率	28.9%		

1月6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
国債買現先(1/7~1/14)	20,000	45,818	20,005	▲0.100	▲0.095	26.3
国債買入(1/7~)	1~3年	4,500	10,846	4,505	0.003	0.004
	3~5年	4,500	14,761	4,503	0.008	0.012
	10~25年	1,500	4,797	1,505	0.012	0.013
国債補完供給(1/6~1/7)	217	217	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マネタリーベース [億円]

1月5日時点 6,672,500

所要

今積期の所要準備額 3,769,300

1月7日以降の残り所要

積数 100

平均 0

国庫短期証券入札予定

1月7日	3ヶ月(第1050回)
1月14日	3ヶ月
1月19日	1年
1月21日	3ヶ月
国債入札予定	
1月7日	30年
1月12日	5年
1月14日	20年
1月25日	40年

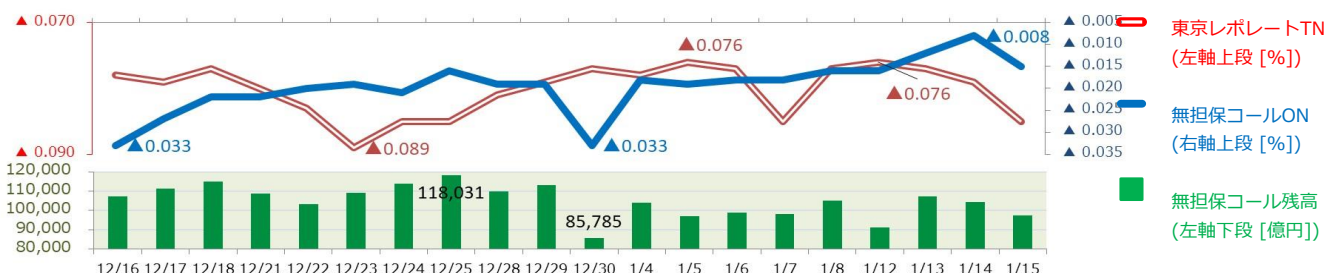
今月の国債買入オペ予定

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	月1回	12月8日	1
1年超3年以下	4500	4,500	6 11 17 20	1月6日	3
3年超5年以下	4500	4,500	6 17 20 26	1月6日	3
5年超10年以下	4250	4,250	11 17 20 26	12月24日	4
10年超25年以下	1500	1,500	6 17	1月6日	0
25年超	500	500		12月15日	1
物価連動債	600	600	月1回	12月24日	1
変動利付債<四半期>	300	300	四半期に1回	10月13日	1

1年前の市場推移

○2020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