



短期市場の推移

	12月30日	1月4日	1月5日	1月6日
加重平均金利	▲0.018	▲0.016	▲0.012	▲0.009
東京レポレート(TN)	▲0.079	▲0.076	▲0.069	▲0.076
無コール残	110,014	132,664	149,606	162,051
ON	62,886	68,936	79,293	87,848
その他	47,128	63,728	70,313	74,203
有コール残	15,928	16,821	17,673	17,790

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	▲0.070	0.001	▲0.008	▲0.077
T/N	-	-	-	▲0.078
S/N	-	-	▲0.005	-
1W	-	-	-	▲0.079
2W	-	-	▲0.015	▲0.081
3W	-	-	-	▲0.085
1M	-	-	▲0.001	▲0.088
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.105
6M	-	-	-	▲0.119
1Y	-	-	-	▲0.129

無担保コール(速報)は日銀、東京レポレートは日本証券業協会公表

1月11日の予定 (時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
	-		-	
	-		-	
	-		-	

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

4日積みとなる本日の無担保コールON物は、▲0.005%の出合から始まり、その後は主に▲0.010%~▲0.002%のレンジで推移した。引き続き都銀・地銀業態を中心に積極的な資金調達が見られ、本日の同加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.001%の▲0.008%(速報)となった。また、日本銀行は1月積み期におけるマクロ加算残高の算出に用いる基準比率を5.5%に定めることとした。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.010 ~ ▲0.010	▲0.005 ~ ▲0.005	▲0.010 ~ ▲0.002

翌営業日のマーケット

一部ビッドサイドに若干の二重低下がみられるものの、大きな動きはなく出合水準は本日対比横ばい圏を予想。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	1月7日	1月11日	1月11日	1月12日	1月12日	1月12日
券	+3,100	+2,800	+2,800	+2,000	+2,000	+2,000
財政	▲1,800	▲10,900	▲10,900			
過不足	+1,300	▲8,100	▲8,100	+4,000	+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
国債買入		+10,600				
国債買現先		+20,600				
CP等買入	▲300					
国債補完供給	+200	▲200				
当座預金増減	+32,200	▲8,100	▲8,100	+4,000	+4,000	
当座預金残高	5,379,400	5,371,300	5,371,300	5,375,300	5,375,300	
準備預金残高	4,774,400					
積み終了先	4,774,400					
超過準備	4,774,400					
非準備先残高	605,000					
準備預金進捗率	100.0%					
平均	83.9%					
乖離率	16.1%					

1月7日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
社債等買入(1/13~)	1,250	3,771	1,250	0.015	0.020	77.3
国債補完供給(1/7~1/11)	221	221	▲0.350	▲0.350		
	11	11	▲0.350	▲0.350		

マネタリーベース (億円)
1月6日時点 6,609,500

所要	今積期の所要準備額
1月11日以降の残り所要	3,767,400
積数	0
平均	0

国債短期証券入札予定

1月14日	3ヶ月(第1051回)
1月19日	1年
1月21日	3ヶ月
1月24日	6ヶ月

国債入札予定

1月12日	5年
1月14日	20年
1月25日	40年
1月27日	2年

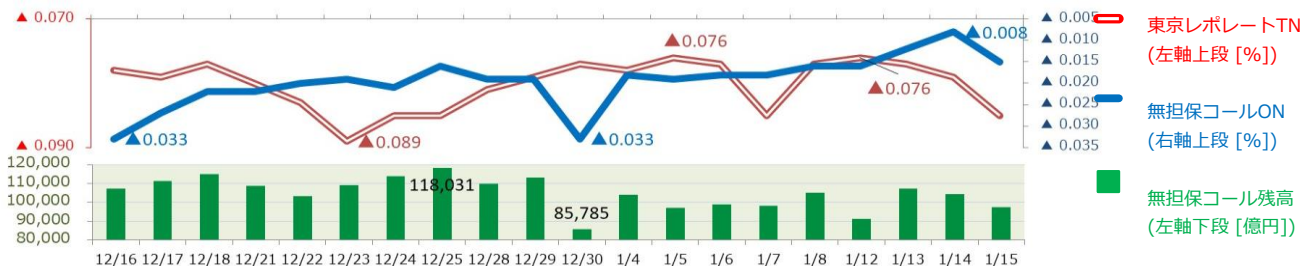
今月の国債買入オペ予定

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	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	1月6日	0
25年超	500	500	17	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