



短期市場の推移

	1月7日	1月11日	1月12日	1月13日
加重平均金利	▲0.008	▲0.014	▲0.021	▲0.021
東京レポレート(TN)	▲0.078	▲0.087	▲0.087	▲0.087
無コール残	169,981	155,257	168,520	175,527
ON	95,543	85,054	98,787	107,004
その他	74,438	70,203	69,733	68,523
有コール残	17,247	16,922	16,861	18,296

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	▲0.065	0.001	▲0.020	▲0.084
T/N	-	-	▲0.010	▲0.085
S/N	-	-	▲0.005	-
1W	▲0.019	▲0.003	▲0.013	▲0.086
2W	▲0.060	0.005	▲0.034	▲0.088
3W	-	-	-	▲0.089
1M	-	-	▲0.003	▲0.094
2M	-	-	-	-
3M	-	-	0.010	▲0.102
6M	-	-	-	▲0.117
1Y	-	-	-	▲0.128

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17日の予定 (時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
日銀金融政策決定会合 (1日目)			(米)休場 (キング牧師誕生日)		
8:50	11月コア機械受注[前月比]	+1.1%			

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▲0.015%の出合から始まり、その後は主に▲0.040%~▲0.010%のレンジで推移した。積み期最終日にかかる3日積みであったが、昨日に引き続きビッドサイドの調達ニーズは残り、本日の同加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.001の▲0.020%(速報)となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.050 ~ ▲0.035	▲0.010 ~ ▲0.010	▲0.050 ~ ▲0.005

翌営業日のマーケット

新積み期に入り、オファーサイドの放出量が増加するため、出合いの水準は低下すると予想。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	1月14日		1月17日		1月18日	
券	+2,500		+1,800		+2,000	
財政	+10,000		▲23,900		+2,000	
過不足	+12,500		▲22,100		+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
国債買現先	▲20,600					
共通担保(全店)					▲3,800	
CP等買入	▲900		▲500			
国債補完供給	+300	▲200	+200			
当座預金増減	▲8,900		▲22,400		+200	
当座預金残高	5,349,100		5,326,700		5,326,900	
準備預金残高	4,763,400		4,763,400		主な需給要因	
積み終了先	4,763,400		国庫短期証券			
超過準備	4,763,400		発行・償還(3M)			
非準備先残高	585,700		国債発行(20年)			
準備預金進捗率	100.0%					
平均	100.0%					
乖離率	0.0%					

1月14日のオペ結果

CP等買入(1/19~) 5,000 8,320 4,995 ▲0.012 ▲0.010 67.5

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
国債補完供給(1/14~1/17)	153	153	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マネタリーベース (億円)
1月13日時点 6,610,000

所要	(億円)
来積み期の所要準備額	3,779,800
1月17日以降の残り所要	
積数	404,300
平均	13,500

国庫短期証券入札予定

1月19日	1年(第1052回)
1月21日	3ヶ月(第1053回)
1月24日	6ヶ月
1月28日	3ヶ月

国債入札予定

1月25日	40年
1月27日	2年
2月1日	10年
2月3日	30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	1月11日	0
1年超3年以下	4500	4,500	6 11 17 20	1月11日	2
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	1月11日	3
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

○2021年1月積み期 [1月15日~2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