



短期市場の推移

	1月11日	1月12日	1月13日	1月14日
加重平均金利	▲0.014	▲0.021	▲0.021	▲0.020
東京レボレート(TN)	▲0.087	▲0.087	▲0.087	▲0.085
無コール残	155,257	168,520	175,527	147,946
ON	85,054	98,787	107,004	82,393
その他	70,203	69,733	68,523	65,553
有コール残	16,922	16,861	18,296	18,897

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	▲0.080	0.001	▲0.029	▲0.084
T/N	-	-	▲0.010	▲0.085
S/N	-	-	▲0.005	-
1W	▲0.060	▲0.010	▲0.030	▲0.085
2W	▲0.045	0.150	▲0.023	▲0.088
3W	-	-	-	▲0.088
1M	▲0.015	0.060	0.002	▲0.093
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.103
6M	-	-	-	▲0.118
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18日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
1月18日銀金融政策決定会合 (日銀当座預金)	▲0.1%	22:30 (米)1月17日ニューヨーク連銀製造業景気指数	26.0
経済・物価情勢の展望 (日銀)	-	16:00 (英)12月失業率	-

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▲0.030%の合出から始まり、その後は主に▲0.040%~▲0.010%のレンジで推移した。オファーサイドの放出意欲が強まったことにより、本日の同加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.009%の▲0.029%(速報)となった。

都銀・信託	証券	地銀
- ~ -	▲0.030 ~ ▲0.030	▲0.045 ~ ▲0.010

オファーサイド、ビッドサイドともに大きな変化はなく、出合いの水準は横ばい圏と予想。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想
	1月17日	1月18日	1月17日	1月18日	1月19日
券	+1,900	+2,000	+1,900	+2,000	+1,000
財政	▲25,100	+9,500	▲25,100	+9,500	+2,000
過不足	▲23,200	+11,500	▲23,200	+11,500	+3,000
金融調節	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド
国債買入			+13,800		
共通担保(全店)			▲3,800	+3,000	
CP等買入	▲500		▲100		+5,000
国債補充供給	+200	▲100	+100		
当座預金増減	▲23,600	+24,500	▲23,600	+24,500	+8,000
当座預金残高	5,325,500	5,350,000	5,325,500	5,350,000	5,358,000
準備預金残高	4,718,500		4,718,500		
積み終了先	4,697,400		4,697,400		
超過準備	4,330,100		4,330,100		
非準備先残高	607,000		607,000		
準備預金進捗率	99.6%		99.6%		
平均	6.5%		6.5%		
乖離率	93.1%		93.1%		

1月17日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
国債買入(1/18~)						
1~3年	4,500	8,140	4,508	0.000	0.001	71.4
3~5年	4,500	8,667	4,504	▲0.003	▲0.002	50.0
5~10年	4,250	8,187	4,259	▲0.005	▲0.003	21.6
25年~	500	1,592	505	0.002	0.003	66.1
国債補充供給(1/17~1/18)						
127	127	▲0.350	▲0.350			
0	0					
共通担保(全店)(1/18~2/2)						
20,000	2,951	2,951				

マネタリーベース (億円)
 1月14日時点 6,598,700

所要	(億円)
今積期の所要準備額	3,779,800
1月18日以降の残り所要	
積数	15,700
平均	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(第1054回)
1月28日	3ヶ月
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17日	1
3年超5年以下	4500	4,500	6 17 20 26	1月17日	2
5年超10年以下	4250	4,250	11 17 20 26	1月17日	2
10年超25年以下	1500	1,500	6	1月6日	0
25年超	500	500	17	1月17日	0
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