



短期市場の推移

[億円] [%]

	12月25日	12月26日	12月29日	12月30日
加重平均金利	0.728	0.727	0.728	0.727
東京レボレート(TN)	0.743	0.741	0.737	0.752
無コール残	75,432	72,158	74,898	75,990
ON	28,280	26,605	27,865	29,002
その他	47,152	45,553	47,033	46,988
有コール残	26,812	24,529	24,091	23,118

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重。

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	0.700	0.780	0.727	0.742
T/N	-	-	-	0.750
S/N	-	-	-	-
1W	0.734	0.860	0.793	0.739
2W	0.785	0.870	0.805	0.736
3W	-	-	0.850	0.736
1M	0.780	0.840	0.810	0.738
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	0.744
6M	-	-	-	0.772
1Y	-	-	-	0.881

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

資金需給

[億円]

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	1月5日	1月6日	1月6日	1月7日	1月7日	1月7日
券						
財政	+2,200	+3,500	+3,500	+3,000	+3,000	+3,000
過不足	+4,300	▲6,800	▲6,800	▲44,000	▲44,000	▲44,000
金融調節	+6,500	▲3,300	▲3,300	▲41,000	▲41,000	▲41,000
共通担保(全店)	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド	スタート
国債補完供給	+1,700	▲3,500	+3,500		▲8,000	
当座預金増減	+4,700	+200	+200	▲49,000	▲49,000	▲49,000
当座預金残高	4,714,400	4,714,600	4,714,600	4,665,600	4,665,600	4,665,600
準備預金残高	4,313,900			主な需給要因		
積み終了先	4,313,900			国庫短期証券発行償還		
超過準備	4,313,600			(3M)		
非準備先残高	400,500			国債発行(10年)		
準備預金進捗率	99.9%			法人税・消費税・保険		
平均	67.7%			揚げ		
乖離率	32.2%					

国庫短期証券入札予定

1月6日	3ヶ月(第1353回)
1月8日	6ヶ月(第1354回)
1月9日	3ヶ月(第1355回)
1月16日	3ヶ月
国債入札予定	
1月6日	10年
1月8日	30年
1月14日	5年
1月20日	20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	1,000	7		1
1年超3年以下	2,700	3,000	7 15 21		3
3年超5年以下	2,450	2,800	7 21 29		3
5年超10年以下	2,600	3,050	15 21 29		3
10年超25年以下	950	1,150	7 15 29		3
25年超	750	750	15 21		2
物価連動債	400	500	29		1
変動利付債	-	300	-		-

1月6日の予定(時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
8:50	マネタリーベース(12月)		(米)サービス業PMI(12月)		
	-		(欧)サービス業PMI(12月)		
	-		-		

本日の市況

無担保コールON物は0.727%の出合から始まり、その後も同程度で推移した。ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比横ばいの0.727%となった。

都銀・信託	証券	地銀
- ~ -	0.727 ~ 0.727	0.727 ~ 0.727

翌営業日のマーケット

出合いの水準は本日対比横ばい圏を予想する。

[%][億円]※米ドル資金供給は百万\$

1月5日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
国債補完供給(1/5~1/6)	3,404	3,404	0.550	0.550		
	300	300	0.550	0.550		

マネタリーベース [億円]

12月30日時点 5,962,100

所要

今積期の所要準備額	4,132,600
1月6日以降の残り所要	
積数	100
平均	0

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