上田八木短資

デイリーシグナル

2026年1月6日(火)

短期市場の推移 [億円] [%]

	12月26日	12月29日	12月30日	1月5日
加重平均金利	0.727	0.728	0.727	0.727
東京レポレート(TN)	0.741	0.737	0.752	0.750
無コール残	72,158	74,898	75,990	78,874
ON	26,605	27,865	29,002	30,221
その他	45,553	47,033	46,988	48,653
有コール残	24,529	24,091	23,118	25,904

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。

1月7日の予定 (時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
8:50	日銀当座預増減要因（1月見込み）			(米)ADP雇用統計(12月)	
	-			(米)ISM非製造業指数（12月）	
	-			（欧）消費者物価（12月）	

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	0.700	0.728	0.727	0.731
T/N	-	-	-	0.749
S/N	-	-	-	-
1W	0.731	0.732	0.732	0.739
2W	0.710	0.730	0.726	0.738
3W	-	-	-	0.738
1M	0.780	0.920	0.793	0.739
2M	-	-	0.830	-
3M	0.810	0.880	0.866	0.746
6M	-	-	-	0.776
1Y	-	-	-	0.884

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

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$

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8日	
券		+3,700		+2,700		+2,000
財政		+2,200		▲60,000		+1,000
過不足		+5,900		▲57,300		+3,000
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
共通担保(全店)			▲8,000	+8,000		
国債補完供給	+2,100	▲3,000	+3,000			
当座預金増減		+5,000		▲54,300		+3,000
当座預金残高		4,719,400		4,665,100		4,668,100
準備預金残高		4,322,500	主な需給要因			
積み終了先		4,322,400				
超過準備		4,322,400				
非準預先残高		396,900				
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

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
国債補完供給(1/6～1/7)	3,216	3,216	0.550	0.550		
	50	50	0.550	0.550		
共通担保(全店)(1/7～1/21)	8,000	12,550	8,005		63.8	
米ドル資金供給（1/8～1/15）	0	0	3.890	3.890		

マネタリーベース [億円]

1月5日時点	5,964,600

所要 [億円]

今積期の所要準備額	4,132,600
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
1月19日	1年

国債入札予定

1月8日	30年
1月14日	5年
1月20日	20年
1月26日	5年クライメート・トランジション

今月の国債買入オペ予定 [億円]

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	1000	1,000	7						12月3日	1
1年超3年以下	2700	3,000	7	15	21				12月17日	3
3年超5年以下	2450	2,800	7	21	29				12月24日	3
5年超10年以下	2600	3,050	15	21	29				12月24日	3
10年超25年以下	950	1,150	7	15	29				12月24日	3
25年超	750	750	15	21					12月24日	2
物価連動債	400	500	29						12月24日	1
変動利付債	-	300	-						4月14日	-

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