上田八木短資

デイリーシグナル

2026年1月9日(金)

短期市場の推移 [億円] [%]

	1月5日	1月6日	1月7日	1月8日
加重平均金利	0.727	0.727	0.727	0.729
東京レポレート(TN)	0.750	0.749	0.745	0.742
無コール残	78,874	77,913	81,189	82,587
ON	30,221	27,355	28,871	29,779
その他	48,653	50,558	52,318	52,808
有コール残	25,904	26,506	28,200	28,357

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13日の予定 (時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
	-			(米)CPI(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	0.780	0.727	0.743
T/N	-	-	-	0.750
S/N	-	-	-	-
1W	0.720	0.734	0.725	0.739
2W	0.723	0.785	0.732	0.738
3W	-	-	-	0.738
1M	-	-	0.790	0.739
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	0.745
6M	-	-	1.060	0.781
1Y	-	-	-	0.885

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%の出合から始まった。試し取り要因の剥落により、ON物加重平均金利（速報）は前営業日対比▲0.002%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9日		1月13日		1月14日	
券	+2,700		+2,200		+2,000	
財政	▲6,500		▲9,000		▲14,000	
過不足	▲3,800		▲6,800		▲12,000	
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
国債補完供給	+2,100	▲5,800	+5,800			
当座預金増減	▲7,500		▲1,000		▲12,000	
当座預金残高	4,674,000		4,673,000		4,661,000	
準備預金残高	4,279,300		主な需給要因			
積み終了先	4,279,300		国庫短期証券発行償還（3M・6M）			
超過準備	4,279,300					
非準預先残高	394,700					
準備預金進捗率	100.0%					
平均	90.3%					
乖離率	9.7%					

1月9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(1/9～1/13)						
		6,149	6,149	0.450	0.450	
		41	41	0.450	0.450	

マネタリーベース [億円]

1月8日時点	5,922,500

所要 [億円]

今積期の所要準備額	4,128,200
1月13日以降の残り所要	
積数	0
平均	0

国庫短期証券入札予定

1月16日	3ヶ月(第1356回)
1月19日	1年 (第1357回)
1月22日	3ヶ月
1月30日	3ヶ月

国債入札予定

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
1月28日	40年

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						1月7日	0
1年超3年以下	2700	2,700	7	15	21				1月7日	2
3年超5年以下	2450	2,450	7	21	29				1月7日	2
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	950	7	15	29				1月7日	2
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