



短期市場の推移

[億円] [%]

	1月6日	1月7日	1月8日	1月9日
加重平均金利	0.727	0.727	0.729	0.727
東京レボレート(TN)	0.749	0.745	0.742	0.750
無コール残	77,913	81,189	82,587	82,219
ON	27,355	28,871	29,779	29,291
その他	50,558	52,318	52,808	52,928
有コール残	26,506	28,200	28,357	28,133

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	0.746
T/N	-	-	-	0.749
S/N	-	-	-	-
1W	0.770	0.810	0.776	0.741
2W	0.720	0.790	0.730	0.739
3W	-	-	-	0.739
1M	-	-	0.795	0.740
2M	-	-	-	-
3M	-	-	0.850	0.747
6M	-	-	1.000	0.781
1Y	-	-	-	0.886

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13日	1月14日	1月13日	1月14日	1月15日	1月16日
券						
財政						
過不足						
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	+5,800	▲3,900	+3,900			
当座預金増減	▲17,500	▲2,900	▲28,000			
当座預金残高	4,656,500	4,653,600	4,625,600			
準備預金残高	4,267,100	主な需給要因				
積み終了先	4,267,100					
超過準備	4,267,100					
非準備先残高	389,400					
準備預金進捗率	100.0%					
平均	93.5%					
乖離率	6.5%					

1月13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(1/13~1/14)

4,257 4,257 0.550 0.550
10 10 0.550 0.550

米ドル資金供給 (1/15~1/22)

0 0 3.890 3.890

[%][億円]※米ドル資金供給は百万\$

1月14日の予定 (時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
8:50	マネーストック(12月)			(米)PPI(10・11月)	
	-			(米)小売売上高(11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。

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

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	15	21		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