



## 短期市場の推移

[億円][%]

	1月8日	1月9日	1月13日	1月14日
加重平均金利	0.729	0.727	0.727	0.727
東京レボ レート(TN)	0.742	0.750	0.749	0.750
無コール残	82,587	82,219	84,007	87,243
ON	29,779	29,291	30,629	30,545
その他	52,808	52,928	53,378	56,698
有コール残	28,357	28,133	27,393	27,393

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	0.744
T/N	-	-	-	0.749
S/N	-	-	-	-
1W	0.726	0.780	0.738	0.741
2W	0.800	0.900	0.877	0.739
3W	-	-	-	0.739
1M	-	-	0.780	0.740
2M	-	-	0.820	-
3M	-	-	0.880	0.746
6M	-	-	-	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15日	1月16日	1月16日	1月19日	1月19日
券		+2,100	+2,100		+2,000
財政		▲22,600	+7,500		▲7,000
過不足		▲20,500	+9,600		▲5,000
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			+6,600		
国債補完供給	+2,500	▲1,700	+1,700		
当座預金増減		▲19,700	+17,900		▲5,000
当座預金残高		4,621,400	4,639,300		4,634,300
準備預金残高		4,234,700			主な需給要因
積み終了先		4,234,700			国庫短期証券発行償還
超過準備		4,234,700			(3M)
非準備先残高		386,700			流動性供給
準備預金進捗率		100.0%			
平均		100.0%			
乖離率		0.0%			

## 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(第1358回)
1月30日	3ヶ月
国債入札予定	
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
1月30日	2年

## 今月の国債買入オペ予定

オペ種類	一回当たりオペ金額	直近オペ金額	オペ予定日	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15日	1
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	2,600	15 21 29	1月15日	2
10年超25年以下	950	950	7 15 29	1月15日	1
25年超	750	750	15 21	1月15日	1
物価連動債	400	500	29	12月24日	1
変動利付債	-	300	-	4月14日	-

## 1月16日の予定(時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
17:00	業態別の日銀当預残高 (12月)		(米) 鉱工業生産 (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。

[%][億円]※米ドル資金供給は百万\$

## 1月15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(1/16~)						
1~3年	2,700	6,221	2,703	0.001	0.001	83.1
5~10年	2,600	5,544	2,606	▲0.028	▲0.027	86.9
10~25年	950	1,733	951	▲0.026	▲0.021	66.0
25年~	750	1,240	751	▲0.029	▲0.018	73.0
国債補完供給(1/15~1/16)						
	1,838	1,838	0.550	0.550		
	60	60	0.550	0.550		

## マネタリーベース [億円]

1月14日時点 5,874,200

## 所要

所要		[億円]
来積期の所要準備額		4,133,500
1月16日以降の残り所要		
積数		4,133,500
平均		133,300

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