



## 短期市場の推移

[億円] [%]

	1月9日	1月13日	1月14日	1月15日
加重平均金利	0.727	0.727	0.727	0.727
東京レボ レート(TN)	0.750	0.749	0.750	0.749
無コール残	82,219	84,007	87,243	88,061
ON	29,291	30,629	30,545	31,063
その他	52,928	53,378	56,698	56,998
有コール残	28,133	27,393	27,393	27,715

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	0.728	0.727	0.743
T/N	-	-	-	0.750
S/N	-	-	-	-
1W	0.725	0.860	0.761	0.742
2W	0.780	0.880	0.795	0.740
3W	-	-	-	0.740
1M	-	-	-	0.741
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	0.748
6M	-	-	-	0.787
1Y	-	-	-	0.891

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16日	1月19日	1月19日	1月20日	1月20日	1月20日
券		+2,200	+1,300		+2,000	
財政		+6,300	▲12,400		+1,000	
過不足		+8,500	▲11,100		+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
国債買入		+6,600				
社債等買入			▲100			
国債補完供給	+1,700	▲2,300	+2,300			
当座預金増減		+14,500	▲8,900		+3,000	
当座預金残高		4,635,900	4,627,000		4,630,000	
準備預金残高		4,258,500				
積み終了先		4,206,100				
超過準備		2,912,400				
非準備先残高		377,400				
準備預金進捗率		97.7%				
平均		9.7%				
乖離率		88.0%				

国庫短期証券入札予定

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
2月6日	3ヶ月
国債入札予定	
1月20日	20年
1月26日	5年クワイメート・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19日の予定 (時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
13:30	鉱工業生産 (11月)			(欧) 消費者物価指数 (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16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(1/16~1/19)						
	2,347	2,347	0.450	0.450		
	95	95	0.450	0.450		

マネタリーベース [億円]

1月15日時点 5,852,500

所要

[億円]

今積期の所要準備額	4,133,500
1月19日以降の残り所要	
積数	95,300
平均	3,400

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