



短期市場の推移

	1月6日	1月7日	1月11日	1月12日
加重平均金利	▲0.009	▲0.008	▲0.014	▲0.021
東京レポレート(TN)	▲0.076	▲0.078	▲0.087	▲0.087
無コール残	162,051	169,981	155,257	168,520
ON	87,848	95,543	85,054	98,787
その他	74,203	74,438	70,203	69,733
有コール残	17,790	17,247	16,922	16,861

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。
 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	▲0.070	0.001	▲0.021	▲0.082
T/N	-	-	▲0.001	▲0.087
S/N	-	-	▲0.005	-
1W	-	-	▲0.016	▲0.087
2W	▲0.060	▲0.001	▲0.042	▲0.089
3W	-	-	-	▲0.090
1M	▲0.040	0.010	▲0.020	▲0.095
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.103
6M	-	-	-	▲0.118
1Y	-	-	-	▲0.129

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

1月14日の予定 (時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
8:50	12月国内企業物価指数 [前年比]	-	22:30	(米)12月小売売上高	-0.1%
-	-	-	23:15	(米)12月鉱工業生産指数 [前月比]	0.3%
-	-	-	-	-	-

経済指標及び予想値は株式会社フィスコ提供

本日の市況

本日の無担保コールON物は▲0.015%の合出から始まり、その後は主に▲0.040%~▲0.010%のレンジで推移した。前営業日同様、ビッドサイドのニーズは限定的であり、本日の同加重平均金利(速報)は前営業日対比横ばいの▲0.021%(速報)となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.025 ~ ▲0.025	▲0.015 ~ ▲0.010	▲0.050 ~ ▲0.005

翌営業日のマーケット

一部ビッドサイドにニーズの低下がみられるため、出合水準は本日対比若干の低下を予想。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	1月13日		1月14日		1月17日	
券	+2,000		+2,600		+2,000	
財政	▲32,400		+7,000		▲7,000	
過不足	▲30,400		+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	スタート
国庫短期証券買入	+5,000					
国債買現先			▲20,600			
CP等買入	▲100		▲900			
社債等買入	+1,300					
国債補完供給	+400		+300			
当座預金増減	▲24,100		▲11,600		▲5,000	
当座預金残高	5,358,000		5,346,400		5,341,400	
準備預金残高	4,776,800		主な需給要因			
積み終了先	4,776,800		国庫短期証券			
超過準備	4,776,800		発行・償還(3M)			
非準備先残高	581,200		国債発行(20年)			
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)	300	300	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マネタリーベース [億円]
1月12日時点 6,636,200

所要	所要
今積期の所要準備額	3,767,400
1月14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14日	3ヶ月(第1051回)
1月19日	1年(第1052回)
1月21日	3ヶ月
1月24日	6ヶ月

国債入札予定

1月14日	20年
1月25日	40年
1月27日	2年
2月1日	10年

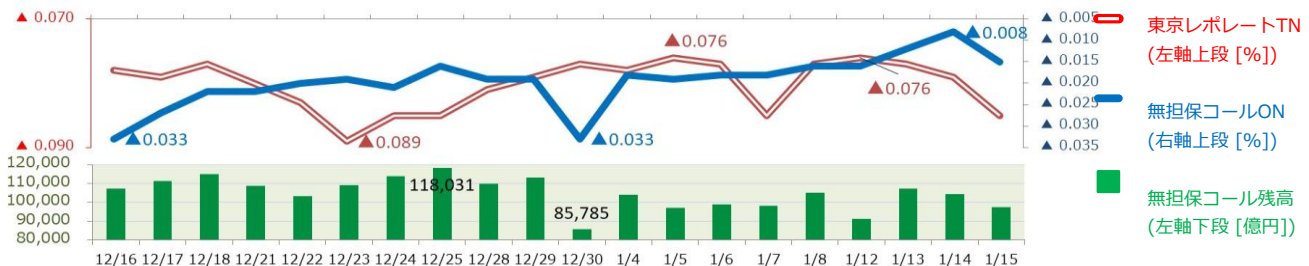
今月の国債買入オペ予定

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	1500	1,500	月1回	1月11日	0
1年超3年以下	4500	4,500	6 11 17 20	1月11日	2
3年超5年以下	4500	4,500	6 17 20 26	1月6日	3
5年超10年以下	4250	4,250	11 17 20 26	1月11日	3
10年超25年以下	1500	1,500	6	1月6日	0
25年超	500	500	17	12月15日	1
物価連動債	600	600	月1回	12月24日	1
変動利付債<四半期>	300	300	四半期に1回	10月13日	1

1年前の市場推移

○2020年12積み期 [12月16日~1月15日]

※積み初日及び積み最終日が祝日・休日の場合は、前営業日のレート・残高を記載しています。



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