



デイリーシグナル

2025年1月7日(火)

短期市場の推移

	12月26日	12月27日	12月30日	1月6日
加重平均金利	0.227	0.227	0.227	0.227
東京レボレート(TN)	0.238	0.239	0.245	0.245
無コール残	74,102	76,029	72,880	75,719
ON	28,686	30,063	29,234	28,308
その他	45,416	45,966	43,646	47,411
有コール残	39,334	39,306	38,644	40,379

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)			レボ市場
	最低	最高	平均	東京レボレート
O/N	0.219	0.228	0.227	0.243
T/N	-	-	-	0.250
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	0.300	0.231
2W	-	-	0.320	0.233
3W	-	-	0.330	0.234
1M	-	-	0.490	0.246
2M	-	-	0.520	-
3M	-	-	0.580	0.325
6M	-	-	-	0.397
1Y	-	-	-	0.494

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

1月8日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	(米) ADP雇用統計 (12月)	-
-	-	(米) 12月17~18日のFOMC議事録	-
-	-	-	-

本日の市況

無担保コールON物は0.227%の出合から始まり、その後は主に同水準を中心に取引された。ビットサイドの資金調達意欲は引き続き底堅く、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比横ばいの0.227%となった。

都銀・信託	証券	地銀
- ~ -	0.227 ~ 0.227	0.226 ~ 0.227

翌営業日のマーケット

ビットサイドの資金調達意欲は引き続き旺盛であるため、出合の水準は本日対比横ばい圏を予想する。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	1月7日	1月8日	1月8日	1月9日	1月9日	1月9日
券	+3,300	+2,800	+2,800	+2,000	+2,000	
財政	▲4,700	▲54,400	▲54,400	+2,000	+2,000	
過不足	▲1,400	▲51,600	▲51,600	+4,000	+4,000	
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
共通担保(全店)	+10,300	▲10,400	▲8,000	+8,000		
国債補充供給		+10,400	+10,400			
当座預金増減	▲1,500	▲41,200	▲41,200	+4,000	+4,000	
当座預金残高	5,295,000	5,253,800	5,253,800	5,257,800	5,257,800	
準備預金残高	4,785,600					主な需給要因
積み終了先	4,785,000					
超過準備	4,785,000					
非準備先残高	509,400					
準備預金進捗率	99.9%					
平均	74.2%					
乖離率	25.7%					

1月7日のオペ結果

[%](億円)※米ドル資金供給は百万\$

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
米ドル資金供給(1/9~1/16)	0	0	4,580	4,580		
国債補充供給(1/7~1/8)	10,822	10,822	▲0.050	▲0.050		
共通担保(全店)(1/8~1/22)	8,000	14,329	8,006		55.9	

マナリーベース (億円)
1月6日時点 6,581,200

所要	所要
今積期の所要準備額	4,063,800
1月8日以降の残り所要	
積数	1,000
平均	100

国庫短期証券入札予定

1月9日	6ヶ月(第1279回)
1月10日	3ヶ月(第1280回)
1月16日	1年
1月17日	3ヶ月
国債入札予定	
1月9日	30年
1月14日	5年
1月16日	20年
1月21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	1500	1,500	15	12月4日	1
1年超3年以下	3000	3,250	8 15 22 28	12月20日	4
3年超5年以下	3000	3,250	8 15 22 28	12月25日	4
5年超10年以下	3250	3,750	8 15 22 30	12月25日	4
10年超25年以下	1500	1,500	8 22 28	12月20日	3
25年超	750	750	15 30	12月25日	2
物価連動債	500	600	30	12月25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