



短期市場の推移

	12月30日	1月6日	1月7日	1月8日
加重平均金利	0.227	0.227	0.227	0.231
東京レボレート(TN)	0.245	0.245	0.250	0.246
無コール残	72,880	75,719	76,704	81,969
ON	29,234	28,308	28,128	31,713
その他	43,646	47,411	48,576	50,256
有コール残	38,644	40,379	40,219	41,289

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	0.275	0.232	0.240
T/N	-	-	-	0.246
S/N	-	-	-	-
1W	0.231	0.295	0.263	0.236
2W	0.285	0.350	0.307	0.237
3W	-	-	0.360	0.240
1M	0.390	0.470	0.410	0.247
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	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10日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
		(米) 雇用統計 (12月)	

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。昨日に引き続き一部金融機関による試し取りが行われた為、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.001%の0.232%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

引き続きビッドサイドの資金調達ニーズは旺盛であるが、試し取り要因剥落のため出合の水準は本日対比低下を予想する。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	1月9日	1月10日	1月10日	1月14日	1月14日	1月14日
券	+2,200	+3,400	+3,400	+3,000	+3,000	
財政	+1,100	▲10,400	▲10,400	▲3,000	▲3,000	
過不足	+3,300	▲7,000	▲7,000	+0	+0	
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		+10,300				
共通担保(全店)			▲20,000	▲20,000	▲20,000	
CP等買入			▲100			
国債補完供給	+9,200	▲8,300	+8,300			
当座預金増減	+14,500	▲18,800	▲18,800	▲20,000	▲20,000	
当座預金残高	5,263,400	5,244,600	5,244,600	5,224,600	5,224,600	
準備預金残高	4,741,700					主な需給要因
積み終了先	4,741,600	国庫短期証券発行償還	国庫短期証券発行償還			
超過準備	4,741,500	(6M)	(3M)			
非準備先残高	521,700	国債発行(30年)				
準備預金進捗率	99.9%					
平均	80.6%					
乖離率	19.3%					

1月9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(1/9~1/10)	8,480	8,480	▲0.050	▲0.050		
	0	0				

マネタリーベース [億円]
1月8日時点 6,527,500

所要	[億円]
今積期の所要準備額	4,067,000
1月10日以降の残り所要	
積数	200
平均	0

国庫短期証券入札予定

1月10日	3ヶ月(第1280回)
1月16日	1年(第1281回)
1月17日	3ヶ月
1月23日	3ヶ月
国債入札予定	
1月14日	5年
1月16日	20年
1月21日	40年
1月29日	5年プライメート・トランジション

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	3,000	8 15 22 28	1月8日	3
3年超5年以下	3000	3,000	8 15 22 28	1月8日	3
5年超10年以下	3250	3,250	8 15 22 30	1月8日	3
10年超25年以下	1500	1,500	8 22 28	1月8日	2
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