



デイリーシグナル

2025年1月14日(火)

	1月7日	1月8日	1月9日	1月10日
加重平均金利	0.227	0.231	0.232	0.227
東京レポレート(TN)	0.250	0.246	0.246	0.248
無コール残	76,704	81,969	83,645	82,190
ON	28,128	31,713	32,909	30,964
その他	48,576	50,256	50,736	51,226
有コール残	40,219	41,289	40,821	42,795

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 [%]

日本	予想	海外	予想
-	-	(米) 12月の消費者物価	-
-	-	(米) ページブック	-
-	-	-	-

	最低	最高	平均	東京レポレート
O/N	0.220	0.228	0.227	0.244
T/N	-	-	-	0.245
S/N	-	-	-	-
1W	0.300	0.450	0.314	0.240
2W	-	-	-	0.241
3W	-	-	-	0.247
1M	-	-	-	0.255
2M	-	-	-	-
3M	0.530	0.610	0.557	0.330
6M	-	-	-	0.397
1Y	-	-	-	0.496

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
 ビッド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。

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	1月14日		1月15日		1月16日	
券	+2,400		+2,400		+3,000	
財政	▲11,500		▲31,800		+5,000	
過不足	▲9,100		▲29,400		+8,000	
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)	▲20,000				▲20,000	
CP等買入	▲100					
国債補完供給	+5,600	▲5,400	+5,400			
当座預金増減	▲29,000		▲24,000		▲12,000	
当座預金残高	5,211,400		5,187,400		5,175,400	
準備預金残高	4,700,600		主な需給要因			
積み終了先	4,700,600		国債発行(5年・個人)			
超過準備	4,700,600		国債償還(個人)			
非準備預金残高	510,800		源泉税揚げ			
準備預金進捗率	100.0%					
平均	96.8%					
乖離率	3.2%					

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(1/16~1/23)	0	0	4,580	4,580		
国債補完供給(1/14~1/15)	5,461	5,461	▲0.050	▲0.050		
	62	62	▲0.050	▲0.050		

マネタリーベース [億円]	所要 [億円]
1月10日時点 6,513,300	今積期の所要準備額 4,067,000
	1月15日以降の残り所要
	積数 0
	平均 0

入札日	期限	回数
1月16日	1年 (第1281回)	
1月17日	3ヶ月 (第1282回)	
1月23日	3ヶ月	
1月31日	3ヶ月	

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