



デイリーシグナル

2025年1月15日(水)

短期市場の推移

	1月8日	1月9日	1月10日	1月14日
加重平均金利	0.231	0.232	0.227	0.227
東京レポレート(TN)	0.246	0.246	0.248	0.245
無コール残	81,969	83,645	82,190	80,745
ON	31,713	32,909	30,964	28,939
その他	50,256	50,736	51,226	51,806
有コール残	41,289	40,821	42,795	42,194

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	0.220	0.228	0.227	0.244
T/N	-	-	-	0.245
S/N	-	-	-	-
1W	0.231	0.500	0.274	0.240
2W	-	-	-	0.244
3W	-	-	-	0.253
1M	-	-	-	0.267
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	0.334
6M	-	-	-	0.398
1Y	-	-	-	0.497

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16日の予定 (時刻は日本時間)

時刻	日本	予想	海外	予想
	17:00	業態別の日銀当座預金残高(12月)		(米) 週間の新規失業保険申請件数
	-		(米) 12月の輸出入物価	
	-		-	

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15日	1月16日	1月16日	1月17日	1月17日
券	+2,600	+2,100	+2,100	+2,000	+2,000
財政	▲25,600	▲1,200	▲1,200	▲8,000	▲8,000
過不足	▲23,000	+900	+900	▲6,000	▲6,000
金融調節	エンド	スタート	エンド	スタート	スタート
国債買入				+11,200	
共通担保(全店)			▲20,000		
国債補完供給	+5,400	▲4,700	+4,700		
当座預金増減	▲22,300	▲3,200	▲3,200	▲6,000	▲6,000
当座預金残高	5,189,100	5,185,900	5,185,900	5,179,900	5,179,900
準備預金残高	4,686,200	主な需給要因			
積み終了先	4,686,200	国債発行(20年)			
超過準備	4,686,200				
非準備先残高	502,900				
準備預金進捗率	100.0%				
平均	100.0%				
乖離率	0.0%				

1月15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
国債買入(1/16~)						
~1年	1,500	3,912	1,503	0.013	0.014	95.4
1~3年	3,000	10,036	3,002	0.001	0.002	26.0
3~5年	3,000	9,098	3,005	▲0.002	0.000	20.1
5~10年	3,250	8,786	3,259	▲0.002	0.004	83.2
25年~	750	1,852	751	0.024	0.027	18.5
国債補完供給(1/15~1/16)						
4,807	4,807	▲0.050	▲0.050			
3	3	▲0.050	▲0.050			

マネタリーベース [億円]
1月14日時点 6,482,000

所要	[億円]
来積期の所要準備額	4,074,100
1月16日以降の残り所要	
積数	4,074,100
平均	131,400

国庫短期証券入札予定

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

国債入札予定

1月16日	20年
1月21日	40年
1月29日	5年クライメート・トランジション
1月31日	2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		1月15日 0
1年超3年以下	3000	3,000	8 15 22 28		1月15日 2
3年超5年以下	3000	3,000	8 15 22 28		1月15日 2
5年超10年以下	3250	3,250	8 15 22 30		1月15日 2
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		1月15日 1
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