



短期市場の推移

	1月9日	1月10日	1月14日	1月15日
加重平均金利	0.232	0.227	0.227	0.227
東京レポレート(TN)	0.246	0.248	0.245	0.245
無コール残	83,645	82,190	80,745	82,949
ON	32,909	30,964	28,939	31,783
その他	50,736	51,226	51,806	51,166
有コール残	40,821	42,795	42,194	42,870

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 [%]

	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	0.241
T/N	-	-	-	0.244
S/N	-	-	-	-
1W	0.232	0.290	0.271	0.241
2W	-	-	-	0.255
3W	-	-	-	0.269
1M	-	-	-	0.291
2M	-	-	-	-
3M	-	-	0.485	0.349
6M	-	-	-	0.410
1Y	-	-	-	0.500

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17日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
		(欧) 消費者物価 (11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で取引された。ビッド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。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想
	1月16日	1月17日	1月17日	1月20日	1月20日
券	+2,300	+2,600	+2,600	+3,000	+3,000
財政	▲200	▲1,200	▲1,200	▲2,000	▲2,000
過不足	+2,100	+1,400	+1,400	+1,000	+1,000
金融調節	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド
国債買入		+11,200			
共通担保(全店)	▲20,000		▲200		▲1,200
CP等買入					
国債補完供給	+4,700	▲4,100	+4,100		
当座預金増減	▲6,100	+5,300	+5,300	▲200	▲200
当座預金残高	5,183,000	5,188,300	5,188,300	5,188,100	5,188,100
準備預金残高	4,673,200	主な需給要因			
積み終了先	3,200,600	国債発行 (20年)		国庫短期証券発行償還 (3M・1Y)	
超過準備	1,234,900				
非準備先残高	509,800				
準備預金進捗率	84.4%				
平均	3.2%				
乖離率	81.2%				

1月16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
国債補完供給(1/16~1/17)	4,231	4,231	▲0.050	▲0.050		
	0	0				

マネタリーベース [億円]
1月15日時点 6,457,000

所要		所要
今積期の所要準備額	4,074,100	
1月17日以降の残り所要		
積数	635,800	
平均	21,200	

国庫短期証券入札予定

1月17日	3ヶ月(第1282回)
1月23日	3ヶ月(第1283回)
1月31日	3ヶ月
2月6日	6ヶ月
国債入札予定	
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
2月4日	10年

今日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