



短期市場の推移

	1月10日	1月14日	1月15日	1月16日
加重平均金利	0.227	0.227	0.227	0.227
東京レボレート(TN)	0.248	0.245	0.245	0.244
無コール残	82,190	80,745	82,949	83,740
ON	30,964	28,939	31,783	32,104
その他	51,226	51,806	51,166	51,636
有コール残	42,795	42,194	42,870	42,900

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)			レボ市場
	最低	最高	平均	東京レボレート
O/N	0.215	0.228	0.227	0.242
T/N	-	-	-	0.243
S/N	-	-	-	-
1W	0.310	0.400	0.364	0.241
2W	-	-	-	0.289
3W	-	-	-	0.320
1M	-	-	-	0.352
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	0.402
6M	-	-	-	0.434
1Y	-	-	-	0.512

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20日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	(米) トランプ氏が大統領に就任	-
-	-	-	-
-	-	-	-

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17日	1月20日	1月20日	1月21日	1月21日	1月21日
券	+2,800	+1,500	+1,500	+2,000	+2,000	
財政	+4,400	+1,000	+1,000	+2,000	+2,000	
過不足	+7,200	+2,500	+2,500	+4,000	+4,000	
金融調節	エンド	スタート	エンド	スタート	スタート	
共通担保(全店)			▲1,200			
CP等買入	▲200					
社債等買入			▲200			
国債補充供給	+3,600	▲7,500	+7,500			
当座預金増減	+3,100	+8,600	+8,600	+4,000	+4,000	
当座預金残高	5,186,100	5,194,700	5,194,700	5,198,700	5,198,700	
準備預金残高	4,689,000					
積み終了先	4,668,300					
超過準備	4,489,600					
非準備先残高	497,100					
準備預金進捗率	99.1%					
平均	12.9%					
乖離率	86.2%					

1月17日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
国債補充供給(1/17~1/20)	7,722	7,722	▲0.050	▲0.050		
	0	0				

マネタリーベース [億円]
1月16日時点 6,448,600

所要	[億円]
今積期の所要準備額	4,074,100
1月20日以降の残り所要	
積数	36,700
平均	1,400

国庫短期証券入札予定

1月23日	3ヶ月(第1283回)
1月31日	3ヶ月
2月6日	6ヶ月
2月7日	3ヶ月
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