

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	▲0.061	▲0.052	▲0.035	▲0.028
東京レポレート(ON)	▲0.061	▲0.083	▲0.112	▲0.092
無コール残	77,028	74,375	80,044	85,267
ON	50,068	46,515	50,619	56,862
その他	26,960	27,860	29,425	28,405
有コール残	25,585	20,295	20,686	21,147

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。

1月16日の予定(時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想	
8:50	11月コア機械受注 [前月比]	+3.1%	22:30 (米)12月小売売上高	0.3%
8:50	12月国内企業物価指数 [前年比]	+0.9%	22:30 (米)1月フィデラルフィア連 銀製造業景況指数	3.4
17:00	業態別の日銀当座 預金残高(12月)	-	-	-

経済指標及び予想値は株式会社フィスコ提供

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	▲0.070	0.001	▲0.016	▲0.076
T/N	-	-	-	▲0.071
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	▲0.020	▲0.073
2W	-	-	▲0.025	▲0.075
3W	-	-	-	▲0.079
1M	▲0.025	▲0.022	▲0.024	▲0.086
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.103
6M	-	-	-	▲0.137
1Y	-	-	-	▲0.161

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

本日の市況

無担保コールON物は▲0.020%の出合から始まった。積み期最終日のため調達意欲が強まり、その後は主に▲0.020%~▲0.010%の水準で取引された。同加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.012%の▲0.0016%と5営業日連続で上昇した。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.020 ~ ▲0.010	▲0.025 ~ ▲0.010	▲0.020 ~ ▲0.005

翌営業日のマーケット

新積み期となるため、調達サイドの動きが慎重になり出合いの水準は低下すると予想。

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	1月17日
券	+2,500	+1,700	+1,700	+1,000	+1,000	+1,000
財政	▲7,400	▲19,600	▲19,600	▲1,000	▲1,000	▲1,000
過不足	▲4,900	▲17,900	▲17,900	+0	+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
国庫短期証券買入				+10,000		
国債買入	+1,500					
CP等買入	▲300		▲100			
ETF買入				+600		
国債補完供給	+200	▲500	+500			
当座預金増減	▲4,000	▲6,900	▲6,900	+0	+0	+0
当座預金残高	3,978,400	3,971,500	3,971,500	3,971,500	3,971,500	3,971,500
準備預金残高	3,480,700	3,480,700	3,480,700	3,480,700	3,480,700	3,480,700
積み終了先	3,480,700	3,480,700	3,480,700	3,480,700	3,480,700	3,480,700
超過準備	3,480,600	3,480,600	3,480,600	3,480,600	3,480,600	3,480,600
非準備先残高	497,700	497,700	497,700	497,700	497,700	497,700
準備預金進捗率	100.0%	100.0%	100.0%	100.0%	100.0%	100.0%
平均	100.0%	100.0%	100.0%	100.0%	100.0%	100.0%
乖離率	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%

1月15日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	接分
国庫短期証券買入(1/16~)	10,000	36,731	10,003	0.011	0.021	63.2
CP等買入(1/20~)	2,500	9,220	2,484	▲0.001	0.000	15.2
国債補完供給(1/15~1/16)		524	524	▲0.350	▲0.350	

マナタリーベース [億円]
1月14日時点 5,134,800

所要 [億円]
来積み期の所要準備額 3,239,200
1月16日以降の残り所要
積数 3,239,200
平均 104,500

国庫短期証券入札予定

1月16日	1年	第882回
1月17日	3ヶ月	第883回
1月24日	3ヶ月	
1月31日	3ヶ月	

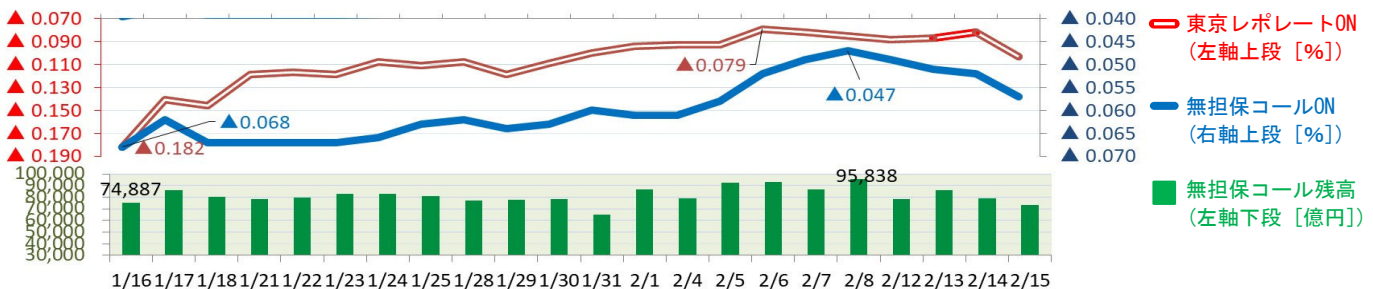
今月の国債買入オペ予定

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	100~1,000 程度	500	月2回程度	12月25日	2
1年超3年以下	3,000~5,500 程度	4,200	6 10 20 29	1月10日	2
3年超5年以下	2,000~4,500 程度	3,400	10 16 23 29	1月10日	3
5年超10年以下	2,000~5,000 程度	3,500	10 16 23 29	1月10日	3
10年超25年以下	500~1,500 程度	1,000	6 14 23	1月14日	1
25年超	0~500 程度	300			
物価連動債	300 程度	300	月2回程度	1月10日	1
変動利付債<偶数月>	1,000 程度	1,000		12月9日	-

1年前の市場推移

○2019年1月積み期 [1月16日~2月15日]

※積み初日及び積み最終日が祝日・休日の場合は、前営業日のレート・残高を記載しています。



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。