

短期市場の推移

[億円] [%]

	1月10日	1月14日	1月15日	1月16日
加重平均金利	▲0.035	▲0.028	▲0.016	▲0.042
東京レポレート(ON)	▲0.112	▲0.092	▲0.076	▲0.074
無コール残	80,044	85,267	91,352	73,386
ON	50,619	56,862	62,347	49,376
その他	29,425	28,405	29,005	24,010
有コール残	20,686	21,147	19,158	19,970

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20日の予定(時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
11月鉱工業生産・確報 (経産省)		-	
-		-	
-		-	

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	▲0.075	0.001	▲0.023	▲0.070
T/N	-	-	-	▲0.057
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.005	0.002	▲0.002	▲0.061
2W	-	-	▲0.030	▲0.062
3W	-	-	-	▲0.065
1M	▲0.025	▲0.022	▲0.024	▲0.072
2M	-	-	▲0.015	-
3M	-	-	-	▲0.099
6M	-	-	-	▲0.134
1Y	-	-	-	▲0.159

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。
その後は主に▲0.025%~▲0.005%の水準で取引された。
地銀・証券業態を中心とした調達ニーズが強く、
同加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.019%の▲0.023%となった。

都銀・信託	証券	地銀
~	▲ 0.020 ~ ▲ 0.015	▲ 0.025 ~ ▲ 0.005

翌営業日のマーケット

週明けも調達ニーズは底堅く、出合いの水準は横ばいと予想する。

資金需給

[億円]

	日銀速報	日銀予想	当社需給予想
	1月17日	1月20日	1月21日
券	+2,400	+1,900	+1,000
財政	+100	▲11,100	+2,000
過不足	+2,500	▲9,200	+3,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国債買入	▲400	▲200	+2,500
CP等買入	▲400	▲200	+100
ETF買入	▲400	▲200	+100
国債補完供給	+800	▲1,500	+1,500
当座預金増減	+5,100	▲5,300	+3,000
当座預金残高	3,970,800	3,965,500	3,968,500
準備預金残高	3,456,400	3,456,400	3,456,400
積み終了先	3,441,400	3,441,400	3,441,400
超過準備	3,248,000	3,248,000	3,248,000
非準備先残高	514,400	514,400	514,400
準備預金進捗率	98.8%	98.8%	98.8%
平均	12.9%	12.9%	12.9%
乖離率	85.9%	85.9%	85.9%

1月17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(1/17~1/20)	1,441	1,441	▲0.350	▲0.350	68	68

マネタリーベース [億円]
1月16日時点 5,113,800

所要 [億円]
今積期の所要準備額 3,239,200
1月20日以降の残り所要
積数 38,200
平均 1,400

国庫短期証券入札予定

1月24日	3ヶ月	第884回
1月31日	3ヶ月	
2月6日	6ヶ月	
2月7日	3ヶ月	
1月28日	40年	
1月30日	2年	
2月4日	10年	
2月6日	30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	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						
5年超10年以下	2,000～5,000 程度	3,500	10	16	23	29	1月16日	2
10年超25年以下	500～1,500 程度	1,000						
25年超	0～500 程度	300	6	14	23		1月14日	1
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。