

短期市場の推移

	1月15日	1月16日	1月17日	1月20日
加重平均金利	▲0.016	▲0.042	▲0.023	▲0.018
東京レポレート(ON)	▲0.076	▲0.074	▲0.070	▲0.049
無コール残	91,352	73,386	84,271	80,805
ON	62,347	49,376	59,411	54,215
その他	29,005	24,010	24,860	26,590
有コール残	19,158	19,970	19,420	18,659

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22日の予定(時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
10:00	営業毎旬報告 (1月20日現在)	-	21:00	(米)MBA住宅ローン申請指数 数[前週比]
14:00	経済・物価情勢の展望 (1月、全文)	-	22:30	(米)12月シカゴ連銀 全米活動指数
	-	-	-	-

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	▲0.018	▲0.070
T/N	-	-	-	▲0.064
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.005	0.002	▲0.003	▲0.061
2W	▲0.030	▲0.005	▲0.009	▲0.063
3W	-	-	-	▲0.065
1M	-	-	-	▲0.070
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.095
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▲0.010%の出合から始まった。その後は主に▲0.015%~▲0.005%の水準で取引された。引き続き資金調達ニーズが強く、同加重平均金利(速報)は前営業日対比横ばいの▲0.018%となった。
本日結果が公表された金融政策決定会合では政策の現状維持が決定された。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.040 ~ ▲0.040	▲0.010 ~ ▲0.010	▲0.015 ~ ▲0.005

翌営業日のマーケット

ビッドサイドの動向に大きな変化はなく、引き続き堅調な地合を予想する。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想
	1月21日	1月22日	1月22日	1月23日	1月23日
券		+1,400		+900	+0
財政		▲800		▲3,300	▲4,000
過不足		+600		▲2,400	▲4,000
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		+8,200			
CP等買入	▲100		▲200		
ETF買入		+100		+600	
国債補完供給	+100	▲100	+100		
当座預金増減		+8,800		▲1,900	▲4,000
当座預金残高		3,974,200		3,972,300	3,968,300
準備預金残高		3,449,800	主な需給要因		
積み終了先		3,445,200			
超過準備		3,443,000			
非率預先残高		524,400			
準備預金進捗率		99.3%			
平均		19.4%			
乖離率		80.0%			

1月21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	接分
国債補完供給(1/21~1/22)	68	68	▲0.350	▲0.350		

マネタリーベース [億円]
1月20日時点 5,109,300

所要 [億円]
今積期の所要準備額 3,239,300
1月22日以降の残り所要
積数 21,200
平均 800

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	1月20日	1
1年超3年以下	3,000~5,500 程度	4,200			
3年超5年以下	2,000~4,500 程度	3,400	6 10 20 29	1月20日	1
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。