

短期市場の推移

[億円] [%]

	1月16日	1月17日	1月20日	1月21日
加重平均金利	▲0.042	▲0.023	▲0.018	▲0.018
東京レポレート(ON)	▲0.074	▲0.070	▲0.049	▲0.070
無コール残	73,386	84,271	80,805	76,564
ON	49,376	59,411	54,215	50,224
その他	24,010	24,860	26,590	26,340
有コール残	19,970	19,420	18,659	18,983

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。

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	▲0.077
T/N	-	-	-	▲0.091
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.010	▲0.005	▲0.007	▲0.083
2W	▲0.010	0.001	▲0.002	▲0.082
3W	-	-	0.001	▲0.083
1M	-	-	-	▲0.085
2M	-	-	-	-
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

1月23日の予定(時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
8:50	12月貿易収支	-1616億円	22:30	(米)新規失業保険申請件数[前週分]
14:00頃	実質輸出入の動向	-		(欧)ECB理事会
	-	-		(欧)カナルECB総裁記者会見

経済指標及び予想値は株式会社フィスコ提供

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。
同加重平均金利(速報)は3営業日連続の▲0.018%となった。

[%]

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

引き続き堅調な地合を予想する。

資金需給

[億円]

	日銀速報	日銀予想	当社需給予想
	1月22日	1月23日	1月24日
券	+900	▲100	+0
財政	▲3,900	▲4,900	+4,000
過不足	▲3,000	▲5,000	+4,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国庫短期証券買入	▲200	▲100	
CP等買入	+600		
ETF買入			
国債補完供給	+100		
当座預金増減	▲2,500	+4,900	+4,000
当座預金残高	3,971,700	3,976,600	3,980,600
準備預金残高	3,443,100	主な需給要因	
積み終了先	3,439,800		
超過準備	3,439,300		
非準備先残高	528,600		
準備預金進捗率	99.5%		
平均	22.6%		
乖離率	76.9%		

1月22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

国庫短期証券買入(1/23~)	10,000	33,245	10,000	0.008	0.014	2.0
-----------------	--------	--------	--------	-------	-------	-----

米ドル資金供給(1/24~1/30)

	0	0	2,040	2,040
--	---	---	-------	-------

マネタリーベース [億円]
1月21日時点 5,116,600

所要	[億円]
今積期の所要準備額	3,239,300
1月23日以降の残リ所要	
積数	17,500
平均	700

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	

国債入札予定

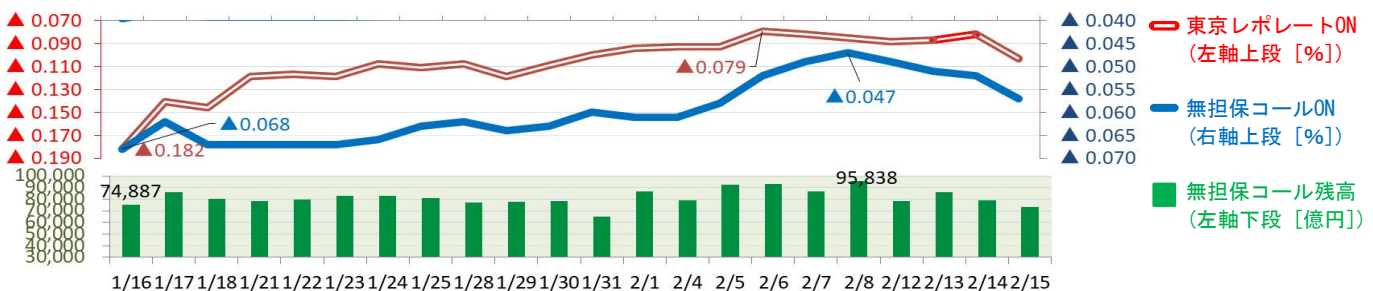
1月28日	40年
1月30日	2年
2月4日	10年
2月6日	30年

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

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。