

短期市場の推移

[億円] [%]

	1月17日	1月20日	1月21日	1月22日
加重平均金利	▲0.023	▲0.018	▲0.018	▲0.018
東京レポレート(ON)	▲0.070	▲0.049	▲0.070	▲0.077
無コール残	84,271	80,805	76,564	77,363
ON	59,411	54,215	50,224	50,913
その他	24,860	26,590	26,340	26,450
有コール残	19,420	18,659	18,983	18,820

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	▲0.055	0.001	▲0.018	▲0.074
T/N	-	-	-	▲0.071
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.005	0.230	0.034	▲0.071
2W	-	-	-	▲0.074
3W	-	-	-	▲0.075
1M	-	-	-	▲0.079
2M	-	-	-	-
3M	-	-	0.070	▲0.099
6M	-	-	-	▲0.132
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24日の予定(時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
8:30	12月消費者物価コア指数[前年比]	-	0:00	(米)12月景気先行指数 -0.002
8:50	政策委員会・金融政策決定会合議事要旨(12月18・19日分)	-	23:45	(米)1月製造業購買部担当者指数(PMI) 52.8
	-	-	23:45	(米)1月サービス業購買部担当者指数(PMI) 52.5

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▲0.020%～▲0.005%の水準で取引された。同加重平均金利(速報)は4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	▲0.020 ~ ▲0.005

翌営業日のマーケット

引き続きビッドサイドの調達意欲は強く、横ばい圏での出合を予想。

資金需給

[億円]

	日銀速報	日銀予想	当社需給予想
	1月23日	1月24日	1月27日
券	▲200	+300	+2,000
財政	▲3,600	+10,600	+13,000
過不足	▲3,800	+10,900	+15,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国庫短期証券買入	+10,000		
国債買入		+5,600	
共通担保(全店)			▲5,900
CP等買入	▲100	▲200	
社債等買入		▲200	
当座預金増減	+6,100	+16,100	+9,100
当座預金残高	3,977,800	3,993,900	4,003,000
準備預金残高	3,454,100	主な需給要因	
積み終了先	3,450,700	国庫短期証券発行・償還(3M)	
超過準備	3,450,700		
非準備先残高	523,700		
準備預金進捗率	99.6%		
平均	25.8%		
乖離率	73.8%		

1月23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
国債買入(1/24~)						
5~10年	3,500	9,506	3,514	▲0.012	▲0.012	80.7
10~25年	1,000	3,273	1,009	▲0.012	▲0.011	92.7
25年~	300	1,283	301	▲0.010	▲0.009	26.2
物価連動	300	1,873	301	▲0.100	▲0.127	90.7
社債等買入(1/29~)						
	1,000	3,151	1,000	0.055	0.064	81.4
国債補完供給(1/23~1/24)		13	13	▲0.350	▲0.350	

マネタリーベース [億円]
1月22日時点 5,113,300

所要 [億円]
今積期の所要準備額 3,239,300
1月24日以降の残り所要
積数 14,100
平均 600

国庫短期証券入札予定

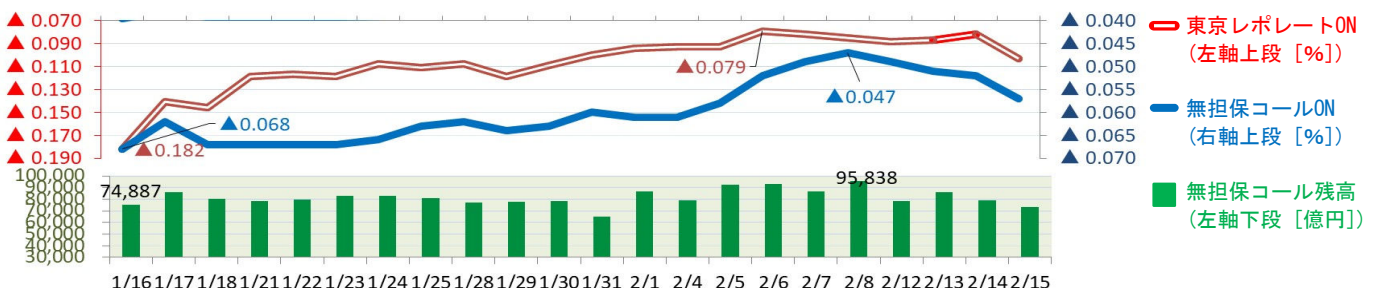
1月24日	3ヶ月	第884回
1月31日	3ヶ月	
2月6日	6ヶ月	
2月7日	3ヶ月	
国債入札予定		
1月28日	40年	
1月30日	2年	
2月4日	10年	
2月6日	30年	

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	4,200	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23日	1
5年超10年以下	2,000~5,000 程度	3,500	10 16 23 29	1月23日	0
10年超25年以下	500~1,500 程度	1,000	6 14 23	1月23日	0
25年超	0~500 程度	300		1月23日	0
物価連動債	300 程度	300	月2回程度	1月23日	0
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。