

短期市場の推移

[億円] [%]

	1月18日	1月21日	1月22日	1月23日
加重平均金利	▲0.067	▲0.067	▲0.067	▲0.067
東京レポレート(ON)	▲0.146	▲0.119	▲0.117	▲0.119
無コール残	80,128	78,351	79,473	82,821
ON	49,898	47,411	47,988	50,601
その他	30,230	30,940	31,485	32,220
有コール残	13,165	14,004	13,724	14,252

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25日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
特になし		0:00 (米)12月景気先行指数	-0.1%
-		18:00 (独)1月IFO企業景況感指数	100.9
-		-	-

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	▲0.086	0.001	▲0.066	▲0.108
T/N	-	-	▲0.020	▲0.122
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	▲0.045	▲0.126
2W	-	-	▲0.017	▲0.130
3W	-	-	-	▲0.132
1M	-	-	▲0.003	▲0.138
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.155
6M	-	-	-	▲0.159
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

本日の無担保コールON物は▲0.086%の出合から始まった。その後は主に、▲0.086%~▲0.030%の水準で出合が見られた。同加重平均金利は前営業日対比+0.001%の▲0.066%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.086 ~ ▲0.086	▲0.080 ~ ▲0.080	▲0.086 ~ ▲0.030

翌営業日のマーケット

明日は週末3日積みとなり、レートは小幅上昇と予想する。

資金需給

[億円]

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想
	1月24日	1月25日	1月25日	1月28日	1月28日
券	▲100	+100	+100	+1,000	+1,000
財政	▲1,300	+3,200	+3,200	▲3,000	▲3,000
過不足	▲1,400	+3,300	+3,300	▲2,000	▲2,000
金融調節	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド
共通担保(全店)					▲5,100
CP等買入	▲100		▲400		
ETF買入		+300			
国債補完供給	+100				
当座預金増減	▲1,100		+2,900		▲7,100
当座預金残高	3,864,000		3,866,900		3,859,800
準備預金残高	3,365,400				
積み終了先	3,364,100				
超過準備	3,363,800				
非準備預金残高	498,600				
準備預金進捗率	99.6%		国債発行(20年)		国庫短期証券発行・償還(3M)
平均	29.0%				
乖離率	70.6%				

1月24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
社債等買入(1/30~)	750	2,130	750	0.053	0.071	18.6
国債補完供給(1/24~1/25)	12,131	7	7	▲0.600	▲0.600	

マナタリーベース [億円]	所要 [億円]
1月23日時点 4,982,200	今積期の所要準備額 3,140,800
	1月25日以降の残り所要積数 11,500
	平均 500

国庫短期証券入札予定

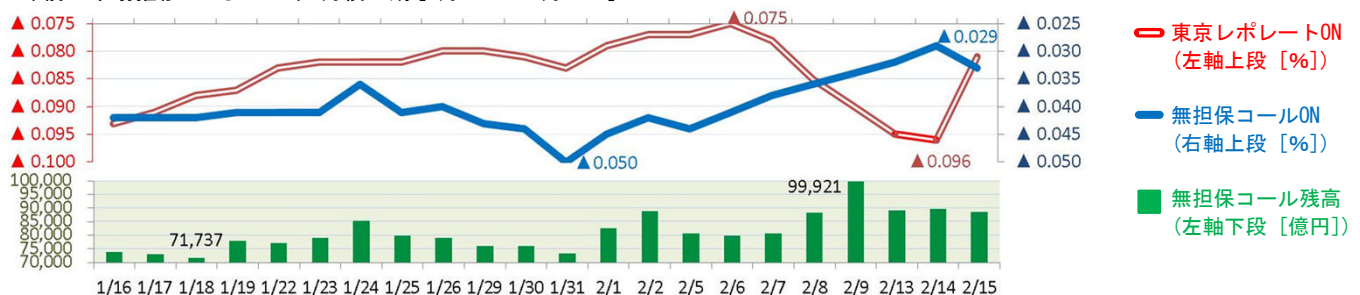
1月25日	3ヶ月	第810回
2月1日	3ヶ月	
2月7日	6ヶ月	
2月8日	3ヶ月	
1月29日	40年	
1月31日	2年	
2月5日	10年	
2月7日	30年	

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17日	1
1年超3年以下	2,500~4,500 程度	3,500			
3年超5年以下	3,000~5,500 程度	4,000	7 15 21 28	1月21日	1
5年超10年以下	3,000~6,000 程度	4,300	4 9 17 25 30	1月17日	2
10年超25年以下	1,500~2,500 程度	2,000			
25年超	100~1,000 程度	500	7 15 21 28	1月21日	1
物価運動債	250 程度	250	月2回程度	1月9日	1
変動利付債<偶数月>	1,000 程度	1,000	-	12月17日	-

1年前の市場推移 ○2018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。