

### 短期市場の推移

[億円] [%]

	1月22日	1月23日	1月24日	1月25日
加重平均金利	▲0.067	▲0.067	▲0.066	▲0.063
東京レポレート(ON)	▲0.117	▲0.119	▲0.108	▲0.111
無コール残	79,473	82,821	82,776	80,872
ON	47,988	50,601	49,026	47,592
その他	31,485	32,220	33,750	33,280
有コール残	13,724	14,252	16,661	15,769

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29日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
8:50 金融政策決定会合議事録等 (2008年7月～12月開催分)	-	FOMC(30日まで)	
1月の月例経済報告		0:00 (米)1月消費者信頼感指数	125.0
		23:00 (米)11月S&P/コアロジックCS20都市住宅価格指数 [前年比]	-

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	▲0.062	▲0.108
T/N	-	-	▲0.020	▲0.124
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.040	0.001	▲0.025	▲0.126
2W	-	-	▲0.017	▲0.126
3W	-	-	▲0.001	▲0.130
1M	-	-	▲0.035	▲0.136
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.155
6M	-	-	-	▲0.159
1Y	-	-	-	▲0.158

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▲0.08%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▲0.062%となった。

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

### 翌営業日のマーケット

本日と大きく変わらず、横ばい圏での推移となると予想する。

### 資金需給

[億円]

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	1月28日	1月29日	1月28日	1月29日	1月30日	1月31日
券	+600	+0	+0	+0	+0	+0
財政	+2,600	+1,000	+1,000	+1,000	+4,000	+4,000
過不足	+3,200	+1,000	+1,000	+1,000	+4,000	+4,000
金融調節	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド	スタート
国債買入	▲4,700	+4,700	+10,400			
共通担保(全店)	▲5,100	+7,000				
CP等買入	▲400		▲200			
社債等買入						+800
ETF買入		+700	+200			
国債補完供給	+100					
当座預金増減	+10,200	+11,400	+11,400			▲3,200
当座預金残高	3,876,700	3,888,100	3,888,100			3,884,900
準備預金残高	3,377,600					
積み終了先	3,376,500					
超過準備	3,376,500					
非準備先残高	499,100					
準備預金進捗率	99.8%					
平均	41.9%					
乖離率	57.8%					

### 1月28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
国債買入(1/29~)						
1~3年	3,500	12,233	3,507	0.004	0.004	82.6
3~5年	4,000	10,129	4,008	0.000	0.001	32.1
10~25年	2,000	4,061	2,008	0.002	0.003	84.1
25年~	500	1,387	504	0.000	0.001	55.4
CP等買入(1/31~)	2,500	7,463	2,482	▲0.001	0.004	51.5
国債補完供給(1/28~1/29)	23,350	25	25	▲0.600	▲0.600	

マナタリーベース [億円]	所要 [億円]
1月25日時点 4,983,600	今積期の所要準備額 3,140,800
	1月29日以降の残り所要積数 7,400
	平均 400

### 国庫短期証券入札予定

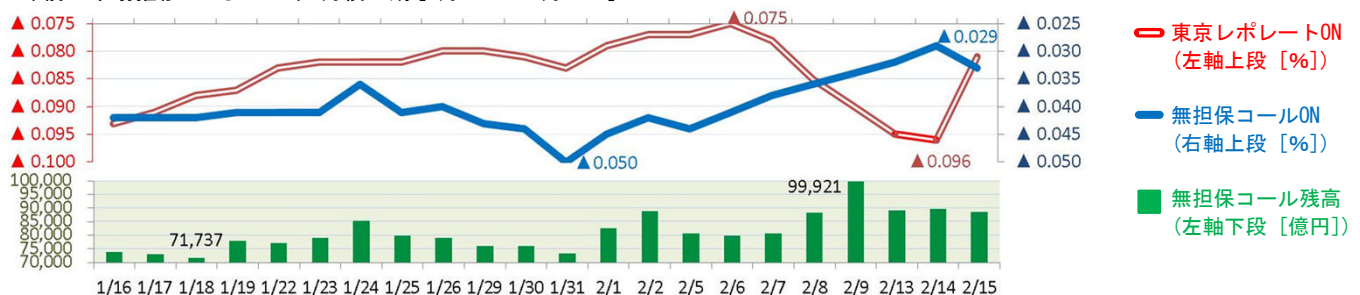
2月1日	3ヶ月	第811回
2月7日	6ヶ月	
2月8日	3ヶ月	
2月15日	3ヶ月	
1月29日	40年	
1月31日	2年	
2月5日	10年	
2月7日	30年	

### 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28日	0
5年超10年以下	3,000~6,000 程度	4,300	4/9/17/25/30	1月25日	1
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28日	0
物価連動債	250 程度	250	月2回程度	1月25日	0
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。