

短期市場の推移

[億円] [%]

	1月24日	1月25日	1月28日	1月29日
加重平均金利	▲0.066	▲0.063	▲0.062	▲0.064
東京レポレート(ON)	▲0.108	▲0.111	▲0.108	▲0.119
無コール残	82,776	80,872	77,083	77,778
ON	49,026	47,592	44,413	45,718
その他	33,750	33,280	32,670	32,060
有コール残	16,661	15,769	24,928	18,187

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31日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
8:50 12月鉱工業生産指数 [前月比]	▲0.5%	4:00 (米)1月連邦公開市場委員会(FOMC)政策金利	2.50%
8:50 金融政策決定会合における主な意見 (1月22-23日分)	-	22:30 (米)新規失業保険申請件数[前週分]	-
10:30 【挨拶】両宮副総裁 (山口)	-	-	-

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

本日の市況

	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	▲0.063	▲0.109
T/N	-	-	▲0.020	▲0.125
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.045	0.001	▲0.036	▲0.126
2W	▲0.025	▲0.020	▲0.023	▲0.126
3W	-	-	0.000	▲0.129
1M	-	-	▲0.010	▲0.135
2M	-	-	-	-
3M	-	-	0.070	▲0.156
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▲0.063%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.086 ~ ▲0.086	▲0.085 ~ ▲0.080	▲0.086 ~ ▲0.030

翌営業日のマーケット

月末であるため一部金融機関が調達を見合わせる見込み。地合は本日より大きく変わらなと予想。

資金需給

[億円]

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想
	1月30日	1月31日	1月31日	2月1日	2月1日
券	+700	▲200	▲200	+0	+0
財政	▲4,700	▲2,400	▲2,400	▲20,000	▲20,000
過不足	▲4,000	▲2,600	▲2,600	▲20,000	▲20,000
金融調節	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド
国庫短期証券買入		+2,500			
国債買入				+4,900	
CP等買入	▲200		▲1,100	+2,500	
社債等買入		+800	▲100		
ETF買入				+1,200	
国債補完供給	+100				
当座預金増減	▲800	+4,800	▲20,000		
当座預金残高	3,883,400	3,888,200	3,868,200		
準備預金残高	3,381,900				
積み終了先	3,380,700				
超過準備	3,380,700				
非準備先残高	501,500				
準備預金進捗率	99.8%				
平均	48.4%				
乖離率	51.5%				

1月30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(1/31~)						
~1年	500	1,236	504	0.000	0.007	47.6
5~10年	4,300	14,411	4,310	0.003	0.004	39.8
国債補完供給(1/30~1/31)						
	19,368	1	1	▲0.600	▲0.600	

マナタリーベース [億円]	所要 [億円]
1月29日時点 5,000,700	今積期の所要準備額 3,141,600
	1月31日以降の残り所要積数 4,900
	平均 300

国庫短期証券入札予定

今月の国債買入オペ予定

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	
国債入札予定		
1月31日	2年	
2月5日	10年	
2月7日	30年	
2月13日	5年	

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30日	0
1年超3年以下	2,500~4,500 程度	3,500		1月28日	0
3年超5年以下	3,000~5,500 程度	4,000	7 15 21 28	1月30日	0
5年超10年以下	3,000~6,000 程度	4,300	4 9 17 25 30	1月28日	0
10年超25年以下	1,500~2,500 程度	2,000		1月25日	0
25年超	100~1,000 程度	500	7 15 21 28	12月17日	-
物価連動債	250 程度	250	月2回程度		
変動利付債<偶数月>	1,000 程度	1,000			

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。