



短期市場の推移

	1月17日	1月18日	1月19日	1月20日
加重平均金利	▲0.029	▲0.028	▲0.026	▲0.025
東京レポレート(TN)	▲0.085	▲0.086	▲0.086	▲0.086
無コール残	170,003	173,166	170,660	177,040
ON	103,465	102,723	100,407	105,427
その他	66,538	70,443	70,253	71,613
有コール残	17,484	17,320	17,244	16,856

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	▲0.080	0.001	▲0.020	▲0.086
T/N	-	-	▲0.010	▲0.086
S/N	-	-	▲0.005	-
1W	▲0.010	▲0.003	▲0.008	▲0.087
2W	-	-	▲0.008	▲0.088
3W	-	-	-	▲0.089
1M	▲0.015	▲0.012	▲0.013	▲0.094
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.102
6M	-	-	-	▲0.116
1Y	-	-	-	▲0.126

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
-	-	-	-
-	-	-	-
-	-	-	-

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

本日の無担保コールON物は▲0.010%の合出から始まり、その後は主に▲0.040%~▲0.010%のレンジで推移した。週末3日積みによる調達ニーズの高まりにより、本日の同加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.005%の▲0.020%(速報)となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.055 ~ ▲0.055	- ~ -	▲0.025 ~ ▲0.008

翌営業日のマーケット

3日積み要因剥落も、ビッドサイドの調達ニーズは引き続き高いことから、出合水準は本日対比で横ばい圏と予想。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	1月21日	1月22日	1月24日	1月25日	1月25日	1月26日
券		+700	+600	+1,000		
財政		+2,100	▲2,100	+23,000		
過不足		+2,800	▲1,500	+24,000		
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		+13,600				
CP等買入	▲100		▲100			
社債等買入	▲100		▲200			+800
E T F買入		+300				
国債補充供給	+300					
当座預金増減		+16,800	▲1,800	+24,800		
当座預金残高		5,353,500	5,351,700	5,376,500		
準備預金残高		4,725,200				
積み終了先		4,724,900	国庫短期証券発行・償還(3M)	国庫短期証券発行・償還(6M)		
超過準備		4,724,700				
非準備先残高		628,300				
準備預金進捗率		99.9%				
平均		25.8%				
乖離率		74.1%				

1月21日のオペ結果

1月21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
国債補充供給(1/21~1/24)	44	44	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マネタリーベース [億円]
1月20日時点 6,580,100

所要	所要
今積期の所要準備額	3,779,800
1月24日以降の残り所要	
積数	3,600
平均	200

国庫短期証券入札予定

1月24日	6ヶ月(第1054回)
1月28日	3ヶ月(第1055回)
2月4日	3ヶ月
2月9日	6ヶ月

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	1500	1,500	月1回	1月11日	0
1年超3年以下	4500	4,500	6 11 17 20	1月20日	0
3年超5年以下	4500	4,500	6 17 20 26	1月20日	1
5年超10年以下	4250	4,250	11 17 20 26	1月20日	1
10年超25年以下	1500	1,500	6	1月6日	0
25年超	500	500	17	1月17日	0
物価連動債	600	600	月1回	12月24日	-
変動利付債<四半期>	300	300	四半期に1回	1月20日	-

1年前の市場推移

○2021年1月積み期 [1月15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。 上田八木短資株式会社 登録金融機関 近畿財務局長(登金)第243号 加入協会 日本証券業協会