



短期市場の推移

	1月18日	1月19日	1月20日	1月21日
加重平均金利	▲0.028	▲0.026	▲0.025	▲0.020
東京レポレート(TN)	▲0.086	▲0.086	▲0.086	▲0.086
無コール残	173,166	170,660	177,040	182,040
ON	102,723	100,407	105,427	112,377
その他	70,443	70,253	71,613	69,663
有コール残	17,320	17,244	16,856	17,628

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	▲0.021	▲0.086
T/N	-	-	▲0.010	▲0.086
S/N	-	-	▲0.005	-
1W	▲0.013	▲0.005	▲0.011	▲0.087
2W	▲0.010	0.050	0.007	▲0.089
3W	-	-	-	▲0.089
1M	-	-	▲0.012	▲0.094
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.102
6M	-	-	-	▲0.115
1Y	-	-	-	▲0.125

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25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%の合から始まり、その後は主に▲0.040%~▲0.010%のレンジで推移した。3日積み要因は剥落したものの、出し手取り手ともに前営業日と同様の動きを見せ、本日の同加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.001%の▲0.021%(速報)となった。

都銀・信託	証券	地銀
- ~ -	▲0.080 ~ ▲0.070	▲0.025 ~ ▲0.010

翌営業日のマーケット

一部運用ニーズが減退する先が想定され、出合水準は本日対比で若干の上昇と予想。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	1月24日		1月25日		1月26日	
券	+500		+700		+1,000	
財政	▲1,500		+23,600		▲5,000	
過不足	▲1,000		+24,300		▲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
CP等買入	▲100					
社債等買入	▲200		▲100		+800	
国債補完供給	▲100		+100			
当座預金増減	▲1,400		+25,100		▲4,000	
当座預金残高	5,352,100		5,377,200		5,373,200	
準備預金残高	4,725,400		主な需給要因			
積み終了先	4,725,000		国庫短期証券発行・償還(6M)		国債発行(40年)	
超過準備	4,725,000		償還(6M)			
非準備先残高	626,700		財政資金の払い			
準備預金進捗率	99.9%					
平均	29.0%					
乖離率	70.9%					

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	按分
国債補完供給(1/24~1/25)	87	87	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マネタリーベース [億円]
1月21日時点 6,596,100

所要	今積期の所要準備額
1月25日以降の残り所要	3,779,800
積数	3,200
平均	100

国庫短期証券入札予定

1月28日	3ヶ月(第1055回)
2月4日	3ヶ月
2月9日	6ヶ月
2月10日	3ヶ月

国債入札予定

1月25日	40年
1月27日	2年
2月1日	10年
2月3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	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