



デイリーシグナル

2022年1月26日(水)

短期市場の推移

	1月20日	1月21日	1月24日	1月25日
加重平均金利	▲0.025	▲0.020	▲0.021	▲0.021
東京レボレート(TN)	▲0.086	▲0.086	▲0.086	▲0.082
無コール残	177,040	182,040	171,246	182,682
ON	105,427	112,377	102,553	101,849
その他	71,613	69,663	68,693	80,833
有コール残	16,856	17,628	17,303	17,578

加重平均金利・コール残高は日銀、東京レボ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)			レボ市場
	最低	最高	平均	東京レボレート
O/N	▲0.075	0.001	▲0.021	▲0.085
T/N	-	-	▲0.010	▲0.081
S/N	-	-	▲0.005	-
1W	▲0.015	▲0.012	▲0.014	▲0.082
2W	▲0.013	▲0.012	▲0.013	▲0.083
3W	-	-	-	▲0.087
1M	-	-	▲0.001	▲0.093
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.101
6M	-	-	-	▲0.114
1Y	-	-	-	▲0.124

無担保コール(速報)は日銀、東京レボレートは日本証券業協会公表

1月27日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	4:00 (米)1月連邦公開市場委員会 (FOMC)政策金利	0.25%
-	-	22:30 (米)10-12月期国内総生産 (GDP) 速報値(前期比年率)	6.0%
-	-	-	-

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▲0.015%の出合から始まり、その後は主に▲0.040%~▲0.010%のレンジで推移した。オファーサイド・ビッドサイドともに大きな変化はなく、本日の同加重平均金利(速報)は前営業日対比横ばいの▲0.021%(速報)となった。

都銀・信託	証券	地銀
- ~ -	▲0.04 ~ ▲0.04	▲0.030 ~ ▲0.010

翌営業日のマーケット

都合に大きな変化はなく、出合の水準は本日対比横ばい圏と予想。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想
	1月26日		1月27日		1月28日
券	+200		▲600		+0
財政	▲5,900		+9,900		+2,000
過不足	▲5,700		+9,300		+2,000
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				+5,000	
国債買入				+9,500	
CP等買入	▲300		▲100		
社債等買入	▲100				
国債補充供給	+100	▲100	+100		
当座預金増減	▲6,100		+23,800		+2,000
当座預金残高	5,370,400		5,394,200		5,396,200
準備預金残高	4,748,500		主な需給要因		
積み終了先	4,748,200				
超過準備	4,748,200				
非準備先残高	621,900				
準備預金進捗率	99.9%				
平均	35.5%				
乖離率	64.4%				

1月26日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分	
国庫短期証券買入(1/27~)	5,000	25,945	5,001	0.006	0.006	92.4	
国債買入(1/27~)	3~5年	4,500	10,950	4,505	0.002	0.003	20.2
	5~10年	4,250	9,263	4,262	0.003	0.003	77.6
物価連動	600	2,969	600	▲0.430	▲0.435		
CP等買入(1/31~)	5,000	7,133	4,992	▲0.013	▲0.011	20.1	
国債補充供給(1/26~1/27)	85	85	▲0.350	▲0.350			
	0	0					

マネタリーベース (億円)
1月25日時点 6,617,900

所要	(億円)
今積期の所要準備額	3,779,800
1月27日以降の残り所要	
積数	2,500
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27日	2年
2月1日	10年
2月3日	30年
2月8日	物価連動

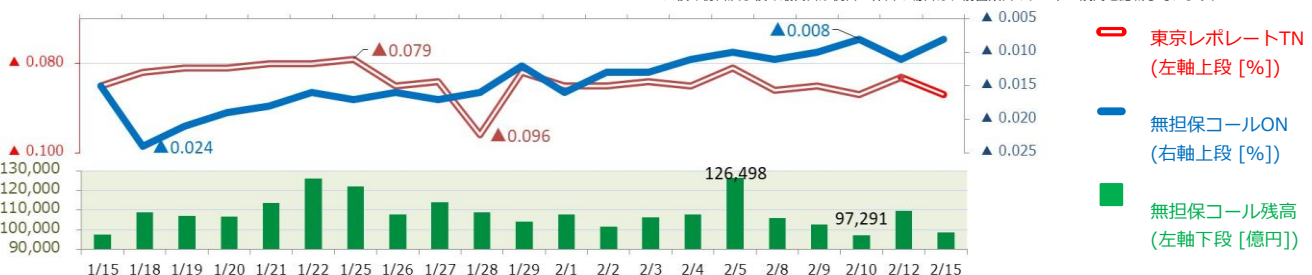
今月の国債買入オペ予定

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26日	0
5年超10年以下	4250	4,250	11 17 20 26	1月26日	0
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	1月26日	0
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