



デイリーシグナル

2022年1月27日(木)

短期市場の推移

	1月21日	1月24日	1月25日	1月26日
加重平均金利	▲0.020	▲0.021	▲0.021	▲0.021
東京レポレート(TN)	▲0.086	▲0.086	▲0.082	▲0.081
無コール残	182,040	171,246	182,682	176,460
ON	112,377	102,553	101,849	95,837
その他	69,663	68,693	80,833	80,623
有コール残	17,628	17,303	17,578	17,466

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	▲0.087
T/N	-	-	▲0.010	▲0.086
S/N	-	-	▲0.005	-
1W	▲0.015	▲0.003	▲0.012	▲0.086
2W	-	-	-	▲0.087
3W	-	-	-	▲0.089
1M	▲0.008	0.230	0.013	▲0.094
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.100
6M	-	-	-	▲0.114
1Y	-	-	-	▲0.124

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28日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	(米)12月個人消費支出 (PCE) 価格コア指数[前年比]	4.8%
-	-	-	-
-	-	-	-

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▲0.013%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。出し手取り手ともに大きな動向の変化はなく、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
▲0.060 ~ ▲0.060	- ~ -	▲0.033 ~ ▲0.010

翌営業日のマーケット

週末3日積み要因により、出合の水準は本日対比で上昇と予想。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	1月27日	1月28日	1月28日	1月31日	1月31日	1月31日
券	▲600	+300	+300	+1,900	+1,900	
財政	+7,500	+9,100	+9,100	+8,900	+8,900	
過不足	+6,900	+9,400	+9,400	+10,800	+10,800	
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
国庫短期証券買入		+5,000				
国債買入		+9,500				
CP等買入	▲100		▲700			+5,000
E T F 買入				+300		
国債補充供給	+100	▲200	+200			
新型コロナ対応金融支援特別						▲132,200
当座預金増減		+21,200	+9,200			▲116,400
当座預金残高		5,391,600	5,400,800			5,284,400
準備預金残高		4,776,100				主な需給要因
積み終了先		4,775,700				
超過準備		4,775,700				
非準備先残高		615,500				
準備預金進捗率		99.9%				
平均		38.7%				
乖離率		61.2%				

1月27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(1/27~1/28)	204	204	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マナリーベース (億円)
1月26日時点 6,611,600

所要	(億円)
今積期の所要準備額	3,779,800
1月28日以降の残り所要	
積数	2,100
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

2月1日	10年
2月3日	30年
2月8日	物価連動
2月15日	5年

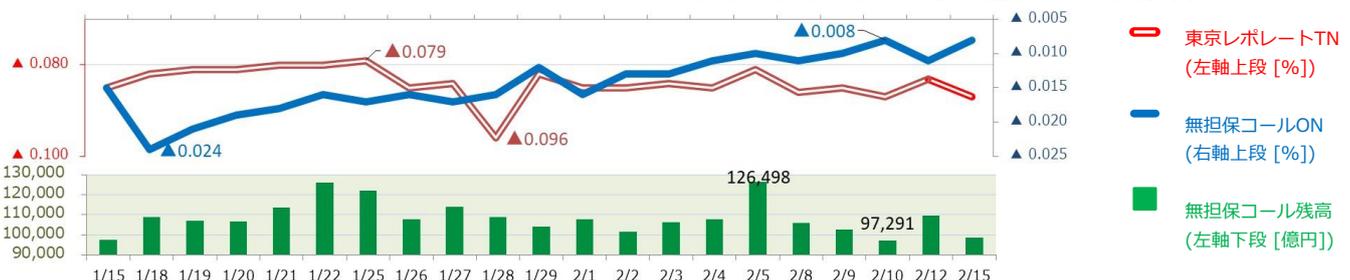
今月の国債買入オペ予定

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	-
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