



短期市場の推移

	12月29日	12月30日	1月4日	1月5日
加重平均金利	▲0.033	▲0.022	▲0.038	▲0.039
東京レポレート(TN)	▲0.153	▲0.094	▲0.096	▲0.095
無コール残	153,422	112,220	131,091	139,789
ON	83,171	72,972	76,414	81,598
その他	70,251	39,248	54,677	58,191
有コール残	27,955	25,115	28,634	28,664

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	▲0.015	▲0.091
T/N	-	-	-	▲0.095
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	-	▲0.103
2W	-	-	-	▲0.111
3W	-	-	0.040	▲0.114
1M	-	-	0.480	▲0.123
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.127
6M	-	-	-	▲0.108
1Y	-	-	-	▲0.098

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10日の予定 (時刻は日本時間)

時刻	日本	予想		海外	
		日本	海外	日本	海外
8:30	東京都都区消費者物価(12月)			-	
				-	
				-	

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▲0.015%~▲0.005%の水準で取引された。積み期終盤かつ4日積み要因により調達を積極化させた大手行、地銀業態によって出合の水準は急上昇し、無担保コールON物金利は前日対比+0.024%の▲0.015%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.015 ~ ▲0.010	-	▲0.015 ~ ▲0.008

翌営業日のマーケット

4日積み要因が剥落し、出合の中心の水準は若干の低下と予想。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	1月6日	1月10日	1月10日	1月11日	1月11日	1月11日
債券	+3,200	+2,700	+2,700	+3,000	+3,000	+3,000
財政	▲66,200	▲24,800	▲24,800	▲5,000	▲5,000	▲5,000
過不足	▲63,000	▲22,100	▲22,100	▲2,000	▲2,000	▲2,000
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		+20,000		+24,100		+4,700
共通担保(全店)				+20,000		▲4,700
CP等買入	▲100		▲100			
国債補完供給	+31,000	▲25,700	+25,700			
当座預金増減	▲37,800	+47,600	+47,600	▲6,700	▲6,700	▲6,700
当座預金残高	5,006,600	5,054,200	5,054,200	5,047,500	5,047,500	5,047,500
準備預金残高	4,385,800	4,385,700	4,385,700	4,385,700	4,385,700	4,385,700
積み終了先						
超過準備	4,385,700					
非準備先残高	620,800					
準備預金進捗率	99.9%					
平均	80.6%					
乖離率	19.3%					

1月6日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
国債買入(固定利回り方式)(1/10~)						
5~10年	5,937	5,937				
5~10年	0	0				
国債買入(1/10~)						
~1年	1,500	7,490	1,500	0.020	0.032	50.0
1~3年	5,000	11,028	5,002	▲0.005	0.000	48.0
3~5年	5,750	7,816	5,753	▲0.023	▲0.013	2.3
5~10年	3,000	15,716	3,005	0.000	0.002	29.5
10~25年	3,000	7,088	3,002	▲0.014	▲0.010	31.5
国債補完供給(1/6~1/10)						
26,037	26,037	▲0.350	▲0.350			
30	30	▲0.350	▲0.350			
共通担保(全店)(1/10~1/10)						
20,000	40,721	20,011			49.1	

マネタリーベース	1月5日時点	所要
1月5日時点	6,338,200	
今積期の所要準備額		3,904,800
1月10日以降の残り所要		
積数		200
平均		0

国債短期証券入札予定

1月10日	3ヶ月(第1131回)
1月13日	3ヶ月(第1132回)
1月19日	1年
1月20日	3ヶ月
1月11日	30年
1月13日	5年
1月19日	20年
1月26日	40年

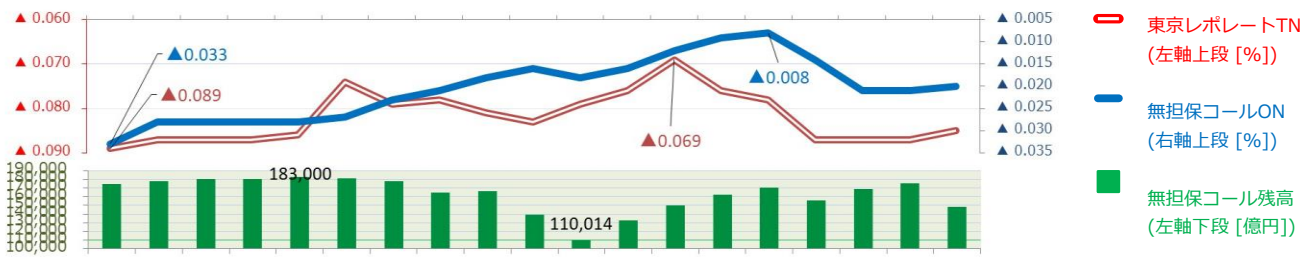
今月の国債買入オペ予定

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6日	0
1年超3年以下	4,250~5,750	5,000	6 12 20 25	1月6日	3
3年超5年以下	5,000~6,000	5,750	6 20 25 30	1月6日	3
5年超10年以下	5,750~7,750	3,000	12 20 25 30	1月6日	4
10年超25年以下	2,000~4,000	3,000	6 12 25 30	1月6日	3
25年超	1,000~3,000	2,000	12 20 30	12月26日	3
物価連動債	600	600	月1回	12月26日	1
変動利付債<四半期>	300	300	四半期に1回	10月17日	1

1年前の市場推移

○2021年12月積み期 [12月16日~1月14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