



短期市場の推移

	12月30日	1月4日	1月5日	1月6日
加重平均金利	▲0.022	▲0.038	▲0.039	▲0.015
東京レボレート(TN)	▲0.094	▲0.096	▲0.095	▲0.095
無コール残	112,220	131,091	139,789	159,517
ON	72,972	76,414	81,598	99,396
その他	39,248	54,677	58,191	60,121
有コール残	25,115	28,634	28,664	31,508

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	▲0.080	0.001	▲0.027	▲0.092
T/N	-	-	-	▲0.100
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.035	▲0.023	▲0.029	▲0.107
2W	▲0.055	▲0.025	▲0.046	▲0.114
3W	-	-	-	▲0.119
1M	-	-	-	▲0.126
2M	-	-	-	-
3M	0.001	0.030	0.014	▲0.127
6M	-	-	-	▲0.110
1Y	-	-	-	▲0.099

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11日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	(米) 週間のMBA住宅ローン申請指数	-
-	-	-	-
-	-	-	-

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%の割合から始まり、その後は主に▲0.040%~▲0.015%の水準で取引された。4日積み要因の剥落によりビッドサイドの調達意欲が減退し、無担保コールON物金利(速報)は前日対比▲0.012%の▲0.027%となった。本日実施予定であったTDB(3M)の入札は1/11(水)へ延期となった。また、本日公表された1月積み期の基準比率は前積み期対比+6.5%の53.0%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.038 ~ ▲0.030	▲0.030 ~ ▲0.030	▲0.040 ~ ▲0.015

翌営業日のマーケット

ビッドサイド、オファーサイド共に動向に大きな変化はなく、出合水準は本日対比横ばい圏を予想する。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想
	1月10日	1月11日	1月11日	1月12日	1月12日
券	+2,800	+2,700	+2,700	+2,000	+2,000
財政	▲20,800	+48,000	+48,000	▲76,000	▲76,000
過不足	▲18,000	+50,700	+50,700	▲74,000	▲74,000
金融調節	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド
国債買入		+24,100		+2,600	
共通担保(全店)		+20,000	▲4,700	+1,400	
CP等買入	▲100				
国債補充供給	+25,700	▲36,700	+36,700		
当座預金増減	+15,000	+86,700	+86,700	▲74,000	▲74,000
当座預金残高	5,021,600	5,108,300	5,108,300	5,034,300	5,034,300
準備預金残高	4,391,100				
積み終了先	4,391,000				
超過準備	4,391,000				
非準備先残高	630,500				
準備預金進捗率	99.9%				
平均	83.9%				
乖離率	16.0%				

1月10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)(1/11~)						
5~10年	2,628	2,628				
5~10年	0	0				
米ドル資金供給(1/12~1/19)						
	0	0	4,580	4,580		
国債補充供給(1/10~1/11)						
	37,110	37,110	▲0.350	▲0.350		
	60	60	▲0.350	▲0.350		
共通担保(全店)(1/11~1/25)						
	1,359	1,359				

マネタリーベース 【億円】
1月6日時点 6,297,200

所要	【億円】
今積期の所要準備額	3,901,400
1月11日以降の残り所要	
積数	200
平均	0

国庫短期証券入札予定

1月11日	3ヶ月(第1131回)変更後
1月13日	3ヶ月(第1132回)
1月19日	1年
1月20日	3ヶ月

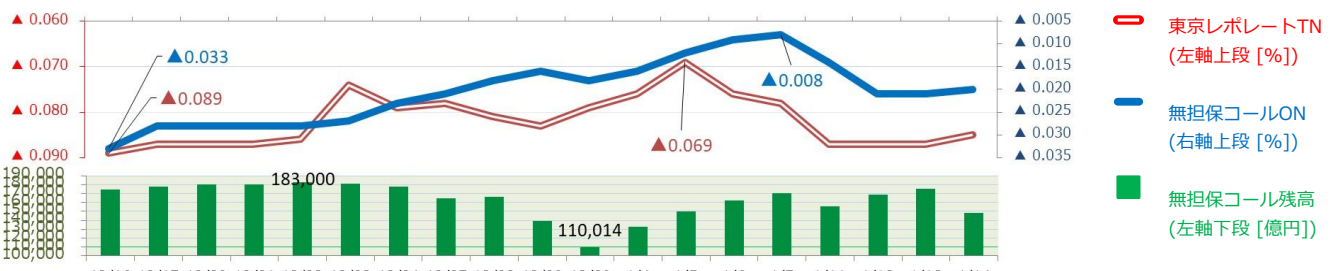
今月の国債買入オペ予定

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。投資については最終決定は、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