



短期市場の推移

[億円] [%]

	1月4日	1月5日	1月6日	1月10日
加重平均金利	▲0.038	▲0.039	▲0.015	▲0.027
東京レボ レート(TN)	▲0.096	▲0.095	▲0.095	▲0.100
無コール残	131,091	139,789	159,517	148,772
ON	76,414	81,598	99,396	88,801
その他	54,677	58,191	60,121	59,971
有コール残	28,634	28,664	31,508	29,626

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	▲0.087	0.001	▲0.030	▲0.097
T/N	-	-	-	▲0.103
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.060	▲0.003	▲0.032	▲0.109
2W	▲0.050	▲0.040	▲0.049	▲0.116
3W	-	-	-	▲0.122
1M	-	-	-	▲0.127
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.127
6M	-	-	-	▲0.109
1Y	-	-	-	▲0.097

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

資金需給

[億円]

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想
	1月11日	1月12日	1月12日	1月13日	1月13日
券		+2,800	+2,000	+2,000	+2,000
財政		+43,500	▲76,000	+1,000	+1,000
過不足		+46,300	▲74,000	+3,000	+3,000
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		+2,600	+12,100		
共通担保(全店)	▲4,700	+1,400	▲300		
CP等買入					
国債補完供給	+36,500	▲34,500	+34,700		
当座預金増減		+47,600	▲27,500	+3,000	+3,000
当座預金残高		5,069,200	5,041,700	5,044,700	5,044,700
準備預金残高		4,430,500			
積み終了先		4,430,500			
超過準備		4,430,500			
非準備先残高		638,700			
準備預金進捗率		99.9%			
平均		87.1%			
乖離率		12.8%			

国庫短期証券入札予定

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27日	3ヶ月

国債入札予定

1月13日	5年
1月19日	20年
1月26日	40年
1月31日	2年

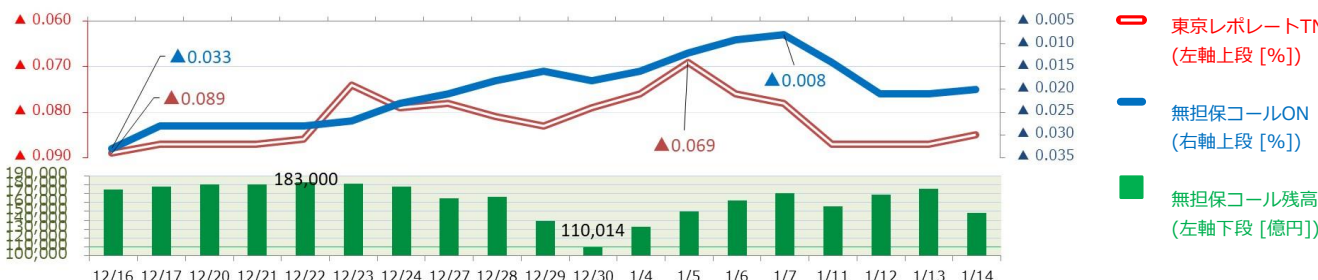
今月の国債買入オペ予定

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	1,000	6 12 20 25	1月11日	3
3年超5年以下	5,000~6,000	1,000	6 20 25 30	1月11日	3
5年超10年以下	5,750~7,750	3,000	12 20 25 30	1月11日	4
10年超25年以下	2,000~4,000	2,000	6 12 25 30	1月11日	3
25年超	1,000~3,000	500	12 20 30	1月11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