



短期市場の推移

	1月6日	1月10日	1月11日	1月12日
加重平均金利	▲0.015	▲0.027	▲0.030	▲0.022
東京レポレート(TN)	▲0.095	▲0.100	▲0.103	▲0.102
無コール残	159,517	148,772	144,190	148,085
ON	99,396	88,801	85,399	89,144
その他	60,121	59,971	58,791	58,941
有コール残	31,508	29,626	29,434	30,527

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	▲0.087	0.001	▲0.035	▲0.096
T/N	-	-	-	▲0.107
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.050	▲0.045	▲0.048	▲0.112
2W	▲0.041	▲0.011	▲0.030	▲0.118
3W	-	-	-	▲0.123
1M	-	-	-	▲0.129
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.129
6M	-	-	-	▲0.107
1Y	-	-	-	▲0.091

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16日の予定 (時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
8:50	12月国内企業物価指数 [前年比]	+9.5%	-	(米)休場 (キング牧師誕生日)	-

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▲0.025%の出合から始まり、その後は主に▲0.035%~▲0.025%の水準で取引された。週末3日積みみではあったが、調達を控える動きが散見され、無担保コールON物金利(速報)は前営業日比▲0.013%の▲0.035%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.040 ~ ▲0.035	▲0.035 ~ ▲0.035	▲0.035 ~ ▲0.025

翌営業日のマーケット

新積み期初日のため、ビッドサイドが慎重な動きとなることも想定される。そのため出合い水準は本日対比でやや低下から横ばいと予想。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	1月13日	1月16日	1月16日	1月17日	1月17日	1月17日
券	+2,200	+1,800		+2,000		
財政	▲1,700	▲24,800		+2,000		
過不足	+500	▲23,000		+4,000		
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
国庫短期証券買入	+1,000					
国債買入	+45,500	+49,400				
共通担保(全店)	+20,000	+20,000				
CP等買入	▲400	▲500		+4,000		
国債補充供給	+37,900	▲50,900	+50,900			
当座預金増減	+53,600	+100,800		+4,000		
当座預金残高	5,062,100	5,162,900		5,166,900		
準備預金残高	4,404,800					
積み終了先	4,404,800					
超過準備	4,404,800					
非準備先残高	657,300					
準備預金進捗率	100.0%					
平均	100.0%					
乖離率	0.0%					

1月13日のオペ結果

オベ種類 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)(1/16~)						
5~10年	12,511	12,511				
5~10年	19,563	19,563				
1~3年	0	0				
国債買入(1/16~)						
1~3年	1,000	2,749	1,001	0.015	0.018	31.3
3~5年	5,000	9,364	5,002	0.026	0.048	6.9
5~10年	5,000	15,539	5,002	0.044	0.061	13.3
10~25年	3,000	5,444	3,002	0.025	0.041	64.4
3~5年	1,000	2,655	1,001	0.007	0.009	84.1
5~10年	2,000	7,452	2,000	0.026	0.044	86.0
10~25年	1,000	2,636	1,001	0.002	0.024	46.8
国債補充供給(1/13~1/16)						
	51,847	51,847	▲0.350	▲0.375		
	0	0				
共通担保(全店)(2023/1/16~2025/1/16)						
	20,000	22,162	20,009		90.3	

マナターベース	所要
1月12日時点 6,291,500	来積期の所要準備額 3,910,200
	1月16日以降の残り所要積数 3,910,200
	平均 126,100

国庫短期証券入札予定

1月19日	1年 (第1133回)
1月20日	3ヶ月(第1134回)
1月27日	3ヶ月
2月3日	3ヶ月

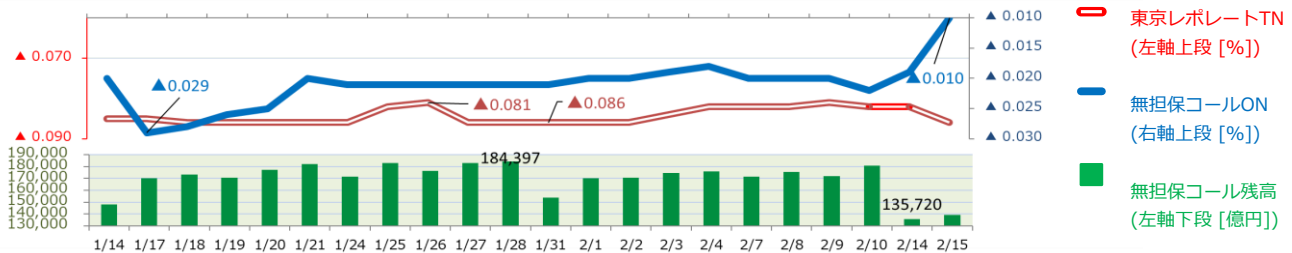
今日の国債買入オペ予定

オベ種類	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13日	2
3年超5年以下	5,000~6,000	1,000	6 20 25 30	1月13日	3
5年超10年以下	5,750~7,750	2,000	12 20 25 30	1月13日	3
10年超25年以下	2,000~4,000	1,000	6 12 25 30	1月13日	2
25年超	1,000~3,000	2,000	12 20 30	1月12日	2
物価運動債	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	1月12日	0

1年前の市場推移

○2022年1月積み期 [1月14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