



短期市場の推移

	1月11日	1月12日	1月13日	1月16日
加重平均金利	▲0.030	▲0.022	▲0.035	▲0.026
東京レポレート(TN)	▲0.103	▲0.102	▲0.107	▲0.112
無コール残	144,190	148,085	149,945	159,346
ON	85,399	89,144	91,454	98,524
その他	58,791	58,941	58,491	60,822
有コール残	29,434	30,527	29,360	29,274

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	▲0.070	0.001	▲0.014	▲0.095
T/N	-	-	-	▲0.117
S/N	-	-	▲0.005	-
1W	-	-	▲0.020	▲0.126
2W	▲0.030	▲0.013	▲0.022	▲0.136
3W	-	-	-	▲0.137
1M	-	-	▲0.010	▲0.143
2M	-	-	-	-
3M	0.010	0.025	0.019	▲0.133
6M	-	-	-	▲0.106
1Y	-	-	-	▲0.086

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18日の予定 (時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
8:50	11月コア機械受注[前月比]	▲1.5%	22:30	(米)12月小売売上高	-0.8%
-	1月1日銀金融政策決定会合(日銀当座預金)	▲0.1%	22:30	(米)12月生産者物価コア指数[前年比]	5.4%
-	-	-	23:15	(米)12月鉱工業生産指数[前月比]	0.0%

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

積み期初日となる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▲0.020%~▲0.010%の水準で取引された。昨日同様大手行を中心に資金調達ニーズは底堅く、無担保コールON物金利(速報)は前営業日比+0.012%の▲0.014%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.025 ~ ▲0.010	▲0.020 ~ ▲0.020	▲0.035 ~ ▲0.008

翌営業日のマーケット

ビッドサイドの調達ニーズは依然強含むと想定され、出合水準は本日対比で上昇を予想する。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	1月17日	1月18日	1月17日	1月18日	1月19日	1月20日
券	+1,700	+1,100	+1,700	+1,100	+1,000	+1,000
財政	+8,700	▲1,400	+8,700	▲1,400	▲4,000	▲4,000
過不足	+10,400	▲300	+10,400	▲300	▲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	スタート
国庫短期証券買入		+21,200		+1,000		+8,800
国債買入	▲100	▲400	▲100	▲400		
CP等買入						
国債補充供給	+78,100	+85,000	+78,100	+85,000		
当座預金増減	+24,600	+94,100	+24,600	+94,100	▲3,000	▲3,000
当座預金残高	5,109,300	5,203,400	5,109,300	5,203,400	5,200,400	5,200,400
準備預金残高	4,473,200		4,473,200			
積み終了先	4,365,800		4,365,800			
超過準備	3,961,200		3,961,200			
非準備先残高	636,100		636,100			
準備預金進捗率	97.5%		97.5%			
平均	6.5%		6.5%			
乖離率	91.0%		91.0%			

1月17日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
国庫短期証券買入(1/18~)	1,000	3,236	1,000	0.052	0.052	
国債買入(固定利回り方式)(1/18~)						
5~10年		4,288	4,288			
5~10年		4,677	4,677			
米ドル資金供給(1/19~1/26)						
	3	3	4,580	4,580		
国債補充供給(1/17~1/18)						
	83,593	83,593	▲0.350	▲0.435		
	3,044	3,044	▲0.350	▲0.662		

マネタリーベース 【億円】
1月16日時点 6,363,700

所要	【億円】
今積期の所要準備額	3,910,200
1月18日以降の残り所要	
積数	98,000
平均	3,400

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

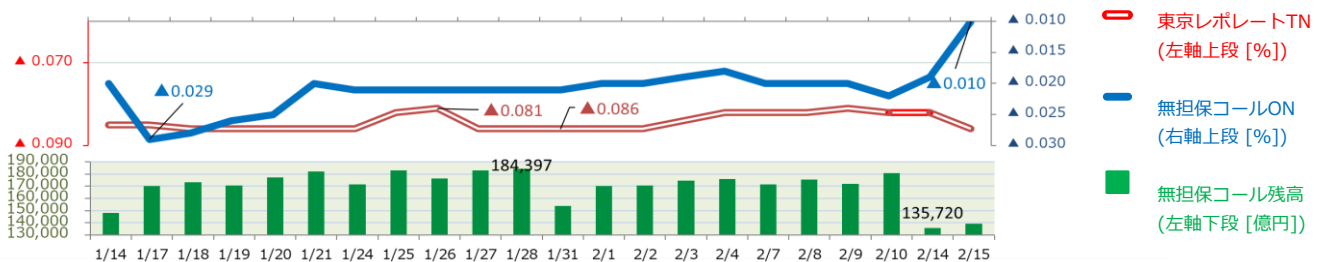
今月の国債買入オペ予定

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16日	2
3年超5年以下	5,000~6,000	5,000	6 20 25 30	1月16日	3
5年超10年以下	5,750~7,750	5,000	12 20 25 30	1月16日	3
10年超25年以下	2,000~4,000	3,000	6 12 25 30	1月16日	2
25年超	1,000~3,000	2,000	12 20 30	1月12日	2
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	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