



短期市場の推移

	1月18日	1月19日	1月20日	1月23日
加重平均金利	▲0.011	▲0.010	▲0.010	▲0.012
東京レポレート(TN)	▲0.122	▲0.111	▲0.102	▲0.098
無コール残	175,278	179,564	180,860	173,686
ON	111,237	119,978	116,484	108,410
その他	64,041	59,586	64,376	65,276
有コール残	27,819	29,654	30,445	29,000

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	▲0.073	0.001	▲0.015	▲0.094
T/N	-	-	-	▲0.096
S/N	-	-	▲0.005	-
1W	-	-	▲0.025	▲0.118
2W	-	-	-	▲0.131
3W	-	-	-	▲0.140
1M	-	-	0.000	▲0.145
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.143
6M	-	-	-	▲0.106
1Y	-	-	-	▲0.083

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25日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	16:00 (英)12月生産者物価産出指数[前年比]	16.4%
-	-	-	-
-	-	-	-

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▲0.010%の割合から始まり、その後は主に▲0.020%~▲0.010%の水準で取引された。ビットサイドが調達にやや慎重な姿勢を見せ、無担保コールON物金利(速報)は前営業日比▲0.003%の▲0.015%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.025 ~ ▲0.012	▲0.020 ~ ▲0.010	▲0.025 ~ ▲0.010

翌営業日のマーケット

ビットサイド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24日		1月25日		1月26日
券	+900		+400		+0
財政	▲4,000		+29,500		+20,000
過不足	▲3,100		+29,900		+20,000
金融調節	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド
国庫短期証券買入				+1,000	
共通担保(全店)		+10,000	▲1,400	+5,800	
CP等買入			▲600		
社債等買入		+1,000	▲400		
国債補充供給	+79,400	▲80,300	+80,300		
当座預金増減	+7,000		+114,600		+20,000
当座預金残高	5,139,600		5,254,200		5,274,200
準備預金残高	4,479,200		4,477,400		
積み終了先	4,477,400		国庫短期証券償還		主な需給要因
超過準備	4,476,000		(6M)		各種財政支払い
非準備先残高	660,400		流動性供給		
準備預金進捗率	99.6%				
平均	29.0%				
乖離率	70.5%				

1月24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(1/25~)	1,000	5,056	1,000	0.016	0.016	
国債買入(固定利回り方式)(1/25~)	5~10年	0	0			
5~10年	0	0				
米ドル資金供給(1/26~2/2)	1	1	4.580	4.580		
国債補充供給(1/24~1/25)	79,789	79,789	▲0.350	▲0.360		
425	425	▲0.350	▲0.360			
共通担保(全店)(1/25~2/8)	5,770	5,770				

マネタリーベース [億円]
1月23日時点 6,406,300

所要	所要
今積期の所要準備額	3,910,200
1月25日以降の残り所要	
積数	16,600
平均	800

国庫短期証券入札予定

1月27日	3ヶ月(第1135回)
2月3日	3ヶ月
2月9日	6ヶ月
2月10日	3ヶ月

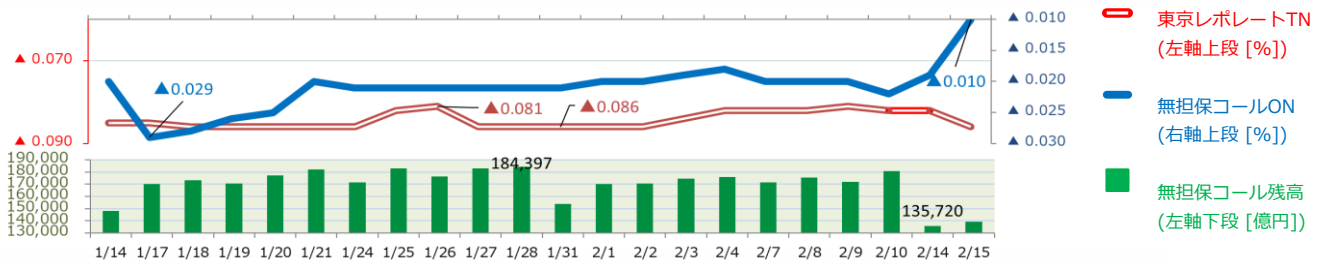
今月の国債買入オペ予定

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