



短期市場の推移

	1月23日	1月24日	1月25日	1月26日
加重平均金利	▲0.012	▲0.015	▲0.014	▲0.014
東京レポレート(TN)	▲0.098	▲0.096	▲0.097	▲0.097
無コール残	173,686	174,865	171,009	173,553
ON	108,410	106,169	101,563	103,507
その他	65,276	68,696	69,446	70,046
有コール残	29,000	29,048	28,864	32,248

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	▲0.080	0.001	▲0.014	▲0.092
T/N	-	-	-	▲0.097
S/N	-	-	▲0.005	-
1W	▲0.010	▲0.002	▲0.005	▲0.113
2W	▲0.030	▲0.025	▲0.028	▲0.127
3W	-	-	-	▲0.137
1M	-	-	▲0.025	▲0.144
2M	-	-	-	-
3M	-	-	0.015	▲0.143
6M	-	-	-	▲0.106
1Y	-	-	-	▲0.081

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30日の予定 (時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
	-			-	
	-			-	
	-			-	

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▲0.012%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。出合いの水準に大きな変化はなく、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比横ばいの▲0.014%となった。

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

翌営業日のマーケット

オファー・ビッドともに大きな変化はなく、出合いの水準は本日対比横ばいと想定。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	1月27日	1月30日	1月30日	1月31日	1月31日	1月31日
券	+500	+500	+500	+900		
財政	▲3,200	+10,100	+10,100	+900		
過不足	▲2,700	+10,600	+10,600	+1,800		
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
CP等買入	▲500	▲1,000	▲1,000	+4,000		
国債補充供給	+77,100	▲77,600	+77,600			
新型コロナ対応金融支援特別	▲8,100	+2,500				
気候変動対応			▲20,500	+28,300		
当座預金増減	▲9,300	+99,000	+99,000	+1,800		
当座預金残高	5,202,800	5,301,800	5,301,800	5,303,600		
準備預金残高	4,547,200	4,546,500	4,546,500			
積み終了先						
超過準備	4,545,000					
非準備先残高	655,600					
準備預金進捗率	99.8%					
平均	45.2%					
乖離率	54.7%					

1月27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)(1/30~)						
5~10年	0	0				
5~10年	0	0				
国債補充供給(1/27~1/30)						
77,743	77,743	▲0.350	▲0.357			
3	3	▲0.350	▲0.350			
気候変動対応(1/30~1/30)						
28,261	28,261					

マネタリーベース (億円)
1月26日時点 6,485,000

所要	(億円)
今積期の所要準備額	3,910,200
1月30日以降の残り所要	
積数	6,400
平均	400

国庫短期証券入札予定

2月3日	3ヶ月(第1136回)
2月9日	6ヶ月
2月10日	3ヶ月
2月16日	1年

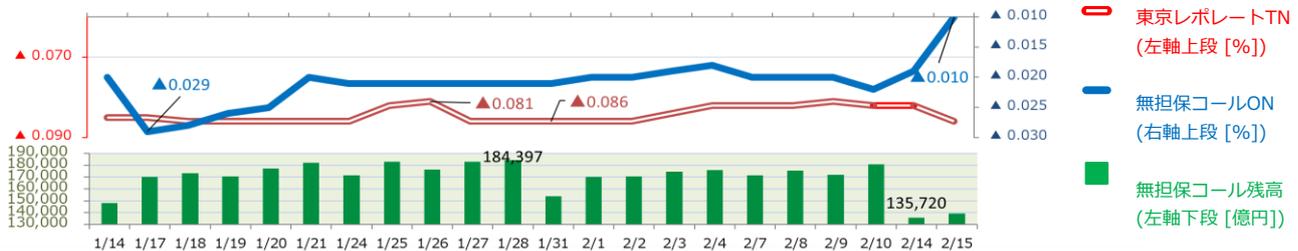
今月の国債買入オペ予定

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	5,000	6 12 20 25	1月25日	0
3年超5年以下	5,000~6,000	5,000	6 20 25 30	1月25日	1
5年超10年以下	5,750~7,750	5,750	12 20 25 30	1月25日	1
10年超25年以下	2,000~4,000	3,000	6 12 25 30	1月25日	1
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