



短期市場の推移

	12月29日	1月4日	1月5日	1月9日
加重平均金利	▲0.039	▲0.021	▲0.018	▲0.017
東京レボレート(TN)	▲0.108	▲0.105	▲0.096	▲0.097
無コール残	115,456	142,284	153,847	158,831
ON	66,708	73,846	79,899	80,568
その他	48,748	68,438	73,948	78,263
有コール残	24,172	26,850	26,655	25,402

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	▲0.080	0.001	▲0.016	▲0.186
T/N	-	-	▲0.012	▲0.146
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.035	0.100	▲0.022	▲0.131
2W	▲0.026	▲0.025	▲0.026	▲0.138
3W	-	-	-	▲0.139
1M	0.015	0.030	0.017	▲0.143
2M	-	-	-	-
3M	0.008	0.040	0.024	▲0.146
6M	-	-	-	▲0.100
1Y	-	-	-	▲0.062

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

1月11日の予定 (時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
14:00	地域経済報告(さくらレポート)		22:30 (米) 消費者物価(12月)	
14:00	景気動向指数速報(11月)		(米) 新規失業保険申請件数(週間)	
15:00	コール市場残高(12月)		-	

本日の市況

無担保コールON物は▲0.013%の合出から始まり、その後は主に▲0.005%~▲0.020%を中心に取引された。引き続きビッドサイドの資金調達意欲は強く、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.001%の▲0.016%となった。

	都銀・信託	証券	地銀
	- ~ -	- ~ -	▲0.025 ~ ▲0.004

翌営業日のマーケット

引き続きビッドサイドの資金調達意欲は底堅く、合出の水準は本日対比横這い圏を予想する。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	1月10日	1月11日	1月11日	1月12日	1月12日	1月13日
券		+2,600	+2,000	+2,000	+2,000	
財政		▲700	▲35,900	▲11,000	▲11,000	
過不足		+1,900	▲33,900	▲9,000	▲9,000	
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
国債買入		+9,500				
共通担保(全店)	▲12,600	+8,400				
CP等買入	▲400		▲300			
社債等買入	▲100					
国債補充供給	+39,700	▲35,200	+35,200			
当座預金増減		+11,200	+1,000	▲9,000	▲9,000	
当座預金残高		5,429,900	5,430,900	5,421,900	5,421,900	
準備預金残高		4,712,300				
積み終了先		4,712,200	国債発行(10年)	源泉税揚げ		
超過準備		4,712,100				
非準備先残高		717,600				
準備預金進捗率		99.9%				
平均		83.9%				
乖離率		16.0%				

1月10日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
国債補充供給(1/10~1/11)	35,302	35,302	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マナリーベース (億円)
1月9日時点 6,703,800

所要	(億円)
今積期の所要準備額	4,033,600
1月11日以降の残り所要	
積数	300
平均	100

国庫短期証券入札予定

1月12日	3ヶ月(第1206回)
1月18日	1年
1月19日	3ヶ月
1月26日	3ヶ月

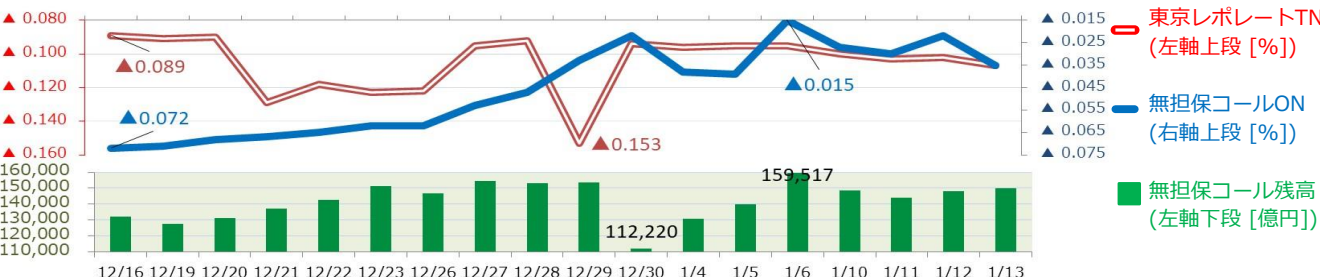
今月の国債買入オペ予定

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	12月13日	1
1年超3年以下	3,000~6,500	3,750	9 15 19 24	1月9日	3
3年超5年以下	3,500~7,500	4,250	9 19 24 29	1月9日	3
5年超10年以下	4,000~9,000	4,750	15 19 24 29	12月25日	4
10年超25年以下	1,000~5,000	1,500	9 15 24	1月9日	2
25年超	500~3,500	750	19 29	12月25日	2
物価連動債	600	600	月1回	12月25日	1
変動利付債	-	300	-	4月14日	-

1年前の市場推移

○2022年12月積み期 [12月16日~1月13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