



短期市場の推移

	1月9日	1月10日	1月11日	1月12日
加重平均金利	▲0.017	▲0.016	▲0.014	▲0.010
東京レボレート(TN)	▲0.097	▲0.146	▲0.107	▲0.103
無コール残	158,831	167,357	172,836	161,905
ON	80,568	83,934	89,553	79,062
その他	78,263	83,423	83,283	82,843
有コール残	25,402	25,259	26,015	25,609

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	▲0.009	▲0.095
T/N	-	-	▲0.027	▲0.110
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.005	▲0.004	▲0.005	▲0.120
2W	▲0.025	▲0.010	▲0.023	▲0.131
3W	0.090	0.100	0.095	▲0.130
1M	▲0.010	▲0.007	▲0.009	▲0.137
2M	-	-	-	-
3M	0.028	0.035	0.031	▲0.147
6M	-	-	-	▲0.095
1Y	-	-	-	▲0.061

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16日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
8:50	企業物価指数(12月)		

本日の市況

無担保コールON物は▲0.005%の出合から始まり、その後は主に▲0.012%~▲0.002%を中心に取引された。本日は12月積み期最終日であり、日銀当座預金残高最終調整のため取り手の調達意欲が強まり、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.001%の▲0.009%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.007 ~ ▲0.002	- ~ -	▲0.012 ~ ▲0.002

翌営業日のマーケット

新積み期初日のため、ビッドサイドの様子見姿勢もあり、本日対比低下を予想する。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想
	1月15日	1月16日	1月16日	1月17日	1月17日
券	+1,800	+1,800	+1,800	+2,000	+2,000
財政	▲15,000	+3,600	+3,600	▲29,000	▲29,000
過不足	▲13,200	+5,400	+5,400	▲27,000	▲27,000
金融調節	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド
国債買入			+11,900		
CP等買入	▲200		+4,000		
国債補完供給	+35,300	▲33,400	+33,400		
当座預金増減	▲11,500	+54,700	+54,700	▲27,000	▲27,000
当座預金残高	5,376,500	5,431,200	5,431,200	5,404,200	5,404,200
準備預金残高	4,698,000				
積み終了先	4,698,000				
超過準備	4,698,000				
非準備先残高	678,500				
準備預金進捗率	100.0%				
平均	100.0%				
乖離率	0.0%				

1月15日のオペ結果

[%][億円] ※米ドル資金供給は百万\$

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
------	------	----	----	----	----	----

国債買入(1/16~)						
~1年	1,500	5,307	1,500	▲0.003	0.005	20.6
1~3年	3,750	10,850	3,755	▲0.005	▲0.004	72.8
5~10年	4,750	13,066	4,760	▲0.037	▲0.033	53.6
10~25年	1,500	4,078	1,503	▲0.040	▲0.035	37.6
国債補完供給(1/15~1/16)						
	33,514	33,514	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マナリーベース	【億円】
1月12日時点	6,665,500

所要	【億円】
来積期の所要準備額	4,040,400
1月16日以降の残り所要	
積数	4,040,400
平均	130,300

国庫短期証券入札予定

1月18日	1年(第1207回)
1月19日	3ヶ月(第1208回)
1月26日	3ヶ月
2月2日	3ヶ月

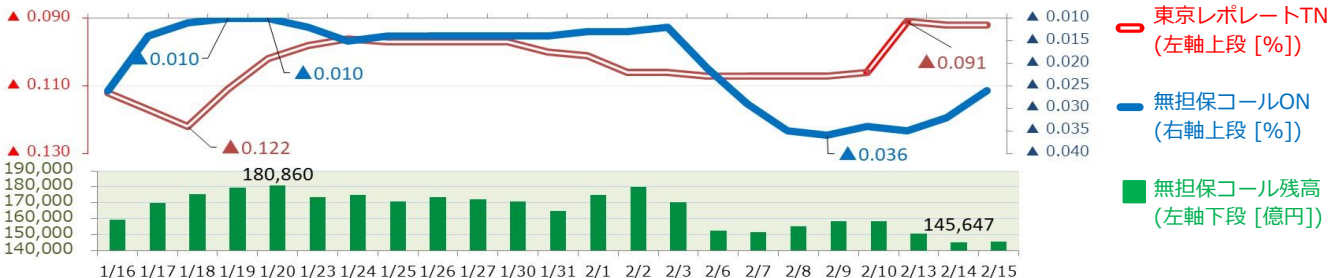
今月の国債買入オペ予定

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15日	0
1年超3年以下	3,000~6,500	3,750	9 15 19 24	1月15日	2
3年超5年以下	3,500~7,500	4,250	9 15 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	1月15日	3
10年超25年以下	1,000~5,000	1,500	9 15 24	1月15日	1
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

○2023年1月積み期 [1月16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。