



短期市場の推移

	1月12日	1月15日	1月16日	1月17日
加重平均金利	▲0.010	▲0.009	▲0.017	▲0.014
東京レボレート(TN)	▲0.103	▲0.110	▲0.101	▲0.097
無コール残	161,905	159,931	172,111	171,707
ON	79,062	76,338	87,538	83,979
その他	82,843	83,593	84,573	87,728
有コール残	25,609	26,163	27,069	26,758

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	▲0.014	▲0.091
T/N	-	-	▲0.010	▲0.093
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.028	▲0.008	▲0.017	▲0.108
2W	▲0.027	▲0.013	▲0.022	▲0.114
3W	-	-	-	▲0.121
1M	▲0.003	0.001	▲0.002	▲0.124
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.144
6M	-	-	-	▲0.094
1Y	-	-	-	▲0.058

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19日の予定 (時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
8:30	全国消費者物価(12月)				

本日の市況

無担保コールON物は▲0.012%の合算から始まり、その後は主に▲0.018%~▲0.010%を中心に取引された。ビッドサイドの調達意欲は底堅く、ON物加重平均金利(速報)は前営業日と横ばいの▲0.014%となった。

都銀・信託		証券	地銀	
-	~	▲0.015 ~ ▲0.015	▲0.018	~ ▲0.010

翌営業日のマーケット

週末3日積みのため、ビッドサイドの調達意欲が強まり、出合の水準は本日対比上昇すると予想。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	1月18日	1月19日	1月19日	1月22日	1月22日	1月22日
券	+1,500	+1,400	+1,400	+1,000	+1,000	
財政	▲6,800	▲5,500	▲5,500	▲3,000	▲3,000	
過不足	▲5,300	▲4,100	▲4,100	▲2,000	▲2,000	
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
CP等買入	▲200		▲800			
社債等買入			▲200			
国債補充供給	+34,000	▲32,800	+32,800			
当座預金増減		▲4,300	+27,700		▲2,000	
当座預金残高		5,369,800	5,397,500		5,395,500	
準備預金残高		4,685,300				
積み終了先		4,666,700	国債発行(20年)			
超過準備		4,643,500			国庫短期証券発行償還(3M・1Y)	
非準備先残高		684,500				
準備預金進捗率		98.4%				
平均		9.7%				
乖離率		88.8%				

1月18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
社債等買入(1/23~)	1,000	2,443	1,000	0.310	0.327	25.5
国債補充供給(1/18~1/19)	32,938	32,938	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マネタリーベース [億円]
1月17日時点 6,646,700

所要	[億円]
今積期の所要準備額	4,040,400
1月19日以降の残り所要	
積数	63,100
平均	2,300

国庫短期証券入札予定

1月19日	3ヶ月(第1208回)
1月26日	3ヶ月
2月2日	3ヶ月
2月8日	6ヶ月
1月25日	40年
1月30日	2年
2月1日	10年
2月5日	物価連動

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 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。投資については最終決定は、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