



短期市場の推移

	1月15日	1月16日	1月17日	1月18日
加重平均金利	▲0.009	▲0.017	▲0.014	▲0.014
東京レボレート(TN)	▲0.110	▲0.101	▲0.097	▲0.093
無コール残	159,931	172,111	171,707	176,121
ON	76,338	87,538	83,979	83,843
その他	83,593	84,573	87,728	92,278
有コール残	26,163	27,069	26,758	25,982

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	0.010	▲0.011	▲0.091
T/N	-	-	▲0.010	▲0.091
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.018	0.001	▲0.011	▲0.105
2W	▲0.027	▲0.001	▲0.014	▲0.114
3W	-	-	▲0.010	▲0.118
1M	▲0.023	0.001	▲0.014	▲0.122
2M	-	-	-	-
3M	-	-	0.035	▲0.144
6M	-	-	-	▲0.094
1Y	-	-	-	▲0.059

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22日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
日銀金融政策決定会合 (1日目)			
-		-	
-		-	

本日の市況

無担保コールON物は▲0.010%の出合いから始まり、その後は主に▲0.012%~▲0.008%を中心に取引された。週末3日積み要因により、ビッドサイドの調達意欲が旺盛となり、ON物加重平均金利(速報)は前営業日+0.003%の▲0.011%となった。

都銀・信託	証券	地銀
- ~ -	▲0.013 ~ ▲0.010	▲0.015 ~ ▲0.007

翌営業日のマーケット

3日積み要因の剥落から、出合い水準は前営業日対比横ばいもしくははやや低下すると予想。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想
	1月19日	1月22日	1月22日	1月23日	1月23日
券		+1,500	+1,000	+1,000	+1,000
財政		▲8,000	▲200	▲6,000	▲6,000
過不足		▲6,500	+800	▲5,000	▲5,000
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			+13,700		
共通担保(全店)				▲8,400	
CP等買入	▲800		▲200		
社債等買入	▲200				
国債補充供給	+32,800	▲32,600	+32,600		
当座預金増減		▲7,300	+46,900	▲13,400	
当座預金残高		5,362,500	5,409,400	5,396,000	
準備預金残高		4,666,200			主な需給要因
積み終了先		4,661,700			国庫短期証券発行償還
超過準備		4,656,000			(3M・1Y)
非準備先残高		696,300			
準備預金進捗率		99.2%			
平均		19.4%			
乖離率		79.8%			

1月19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(1/22~)						
1~3年	3,750	9,673	3,752	▲0.008	▲0.006	19.2
3~5年	4,250	11,785	4,252	▲0.010	▲0.008	90.3
5~10年	4,750	13,601	4,753	▲0.016	▲0.015	92.4
25年~	750	2,670	754	0.000	0.001	91.9
国債補充供給(1/19~1/22)						
	32,283	32,283	▲0.350	▲0.350		
	513	513	▲0.350	▲0.350		

マネタリーベース [億円]
 1月18日時点 6,640,900

所要	[億円]
今積期の所要準備額	4,040,400
1月22日以降の残り所要	
積数	32,400
平均	1,300

国庫短期証券入札予定

1月26日	3ヶ月(第1209回)
2月2日	3ヶ月
2月8日	6ヶ月
2月9日	3ヶ月

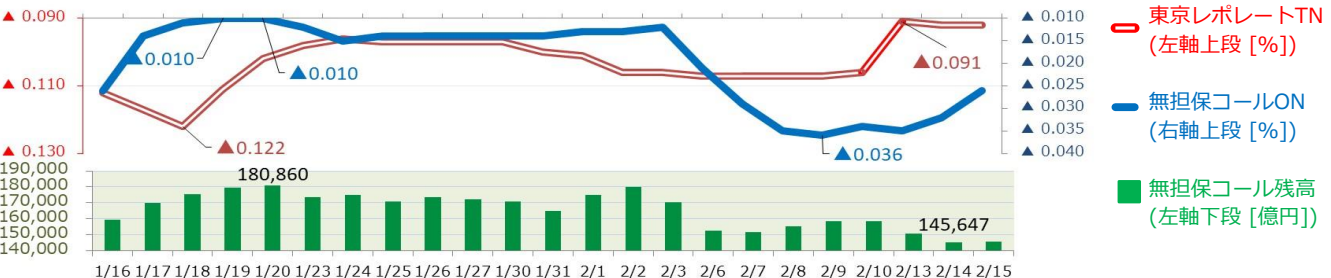
今月の国債買入オペ予定

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19日	1
3年超5年以下	3,500~7,500	4,250	9 19 24 29	1月19日	2
5年超10年以下	4,000~9,000	4,750	15 19 24 29	1月19日	2
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	1月19日	1
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