



短期市場の推移

	1月17日	1月18日	1月19日	1月22日
加重平均金利	▲0.014	▲0.014	▲0.011	▲0.014
東京レボレート(TN)	▲0.097	▲0.093	▲0.091	▲0.081
無コール残	171,707	176,121	176,955	175,536
ON	83,979	83,843	80,547	78,678
その他	87,728	92,278	96,408	96,858
有コール残	26,758	25,982	24,810	28,433

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	▲0.085	0.001	▲0.014	▲0.078
T/N	-	-	▲0.010	▲0.075
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.027	▲0.005	▲0.013	▲0.092
2W	-	-	▲0.023	▲0.104
3W	-	-	-	▲0.111
1M	-	-	-	▲0.116
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.138
6M	-	-	-	▲0.097
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24日の予定 (時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
8:50	貿易収支 (12月)		-	
	-		-	
	-		-	

本日の市況

無担保コールON物は▲0.010%の出会いから始まり、その後は主に▲0.015%~▲0.010%を中心に取引された。オファービッド共に動向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。日本銀行は本日開催の金融政策決定会合にて、現行の金融政策の維持を決定した。

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

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、出合の水準は本日対比横ばい圏を予想する。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	1月23日	1月24日	1月23日	1月24日	1月23日	1月24日
券		+1,200		+700		+0
財政		▲3,900		▲4,500		+16,000
過不足		▲2,700		▲3,800		+16,000
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
共通担保(全店)	▲8,400	+8,500				
社債等買入		+1,000		▲100		
国債補完供給	+34,200	▲34,600	+34,600			
当座預金増減		▲2,000		+30,700		+16,000
当座預金残高		5,375,200		5,405,900		5,421,900
準備預金残高		4,690,200	主な需給要因			
積み終了先		4,687,900	各種財政資金の支払い			
超過準備		4,686,700				
非準備先残高		685,000				
準備預金進捗率		99.4%				
平均		25.8%				
乖離率		73.6%				

1月23日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
米ドル資金供給(1/25~2/1)	0	0	5.580	5.580		
国債補完供給(1/23~1/24)	34,805	34,805	▲0.350	▲0.350		
	1	1	▲0.350	▲0.350		

マネタリーベース (億円)
1月22日時点 6,645,900

所要	(億円)
今積期の所要準備額	4,040,400
1月24日以降の残り所要	
積数	24,400
平均	1,100

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