



デイリーシグナル

2024年1月26日(金)

短期市場の推移

	1月22日	1月23日	1月24日	1月25日
加重平均金利	▲0.014	▲0.014	▲0.013	▲0.012
東京レポレート(TN)	▲0.081	▲0.075	▲0.076	▲0.080
無コール残	175,536	165,747	170,603	172,360
ON	78,678	69,159	74,305	76,187
その他	96,858	96,588	96,298	96,173
有コール残	28,433	26,762	28,368	28,077

加重平均金利・コール残高は日銀、東京レポ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)			レポ市場
	最低	最高	平均	東京レポレート
O/N	▲0.080	0.001	▲0.010	▲0.080
T/N	-	-	▲0.009	▲0.081
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	▲0.010	▲0.089
2W	-	-	-	▲0.097
3W	-	-	-	▲0.106
1M	-	-	-	▲0.111
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.133
6M	-	-	-	▲0.095
1Y	-	-	-	▲0.061

無担保コール(速報)は日銀、東京レポレートは日本証券業協会公表

1月29日の予定 (時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
	-		-	
	-		-	
	-		-	

本日の市況

無担保コールON物は▲0.008%の出合から始まり、その後は主に▲0.013%~▲0.006%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)は前営業日対比+0.002%の▲0.010%となった。

都銀・信託	証券	地銀
- ~ -	▲ 0.008 ~ ▲ 0.008	▲0.013 ~ ▲ 0.006

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26日	1月29日	1月29日	1月30日	1月30日	1月30日
券	+400	+600	+600	+1,000	+1,000	+1,000
財政	▲4,000	+11,100	+11,100	+4,000	+4,000	+4,000
過不足	▲3,600	+11,700	+11,700	+5,000	+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	スタート
CP等買入	▲400		▲100			
社債等買入	▲200					
国債補完供給	+37,300	▲33,500	+33,500			
気候変動対応					▲28,300	
当座預金増減	▲400	+45,100	+45,100	▲23,300	▲23,300	▲23,300
当座預金残高	5,393,400	5,438,500	5,438,500	5,415,200	5,415,200	5,415,200
準備預金残高	4,700,800					
積み終了先	4,698,900					
超過準備	4,698,500					
非準備先残高	692,600					
準備預金進捗率	99.7%					
平均	41.9%					
乖離率	57.7%					

1月26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
CP等買入(1/31~)	4,000	7,790	3,965	0.003	0.012	23.6
国債補完供給(1/26~1/29)	33,870	33,870	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マネタリーベース [億円]
1月25日時点 6,660,100

所要	今積期の所要準備額	4,040,400
1月29日以降の残り所要	積数	13,100
	平均	700

国債短期証券入札予定

2月2日	3ヶ月(第1210回)
2月8日	6ヶ月
2月9日	3ヶ月
2月16日	3ヶ月

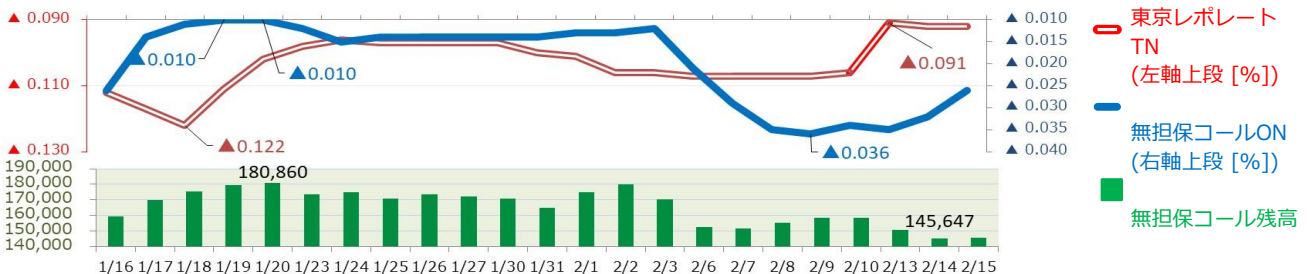
今月の国債買入オペ予定

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24日	0
3年超5年以下	3,500~7,500	4,250	9 19 24 29	1月24日	1
5年超10年以下	4,000~9,000	4,750	15 19 24 29	1月24日	1
10年超25年以下	1,000~5,000	1,500	9 15 24	1月24日	0
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