



### 短期市場の推移

	1月23日	1月24日	1月25日	1月26日
加重平均金利	▲0.014	▲0.013	▲0.012	▲0.010
東京レボレート(TN)	▲0.075	▲0.076	▲0.080	▲0.081
無コール残	165,747	170,603	172,360	170,082
ON	69,159	74,305	76,187	74,949
その他	96,588	96,298	96,173	95,133
有コール残	26,762	28,368	28,077	26,931

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	▲0.087	0.001	▲0.011	▲0.080
T/N	-	-	▲0.008	▲0.081
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	▲0.020	▲0.089
2W	-	-	-	▲0.099
3W	-	-	-	▲0.105
1M	-	-	-	▲0.109
2M	-	-	-	-
3M	-	-	0.026	▲0.128
6M	-	-	-	▲0.093
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30日の予定 (時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
8:30	完全失業率(12月)		(米) FOMC(1日目)	
8:30	有効求人倍率(12月)		(米) 消費者信頼感指数(1月)	
	-		(欧) 10~12月GDP(1次速報値)	

### 本日の市況

無担保コールON物は▲0.009%の合出から始まり、その後は主に▲0.012%~▲0.008%を中心に取引された。週末3日積み要因が剥落したものの、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)は前営業日対比0.001%低下の▲0.011%となった。

	都銀・信託	証券	地銀
	- ~ -	▲0.010 ~ ▲0.010	▲0.012 ~ ▲0.008

### 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、合出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29日	1月30日	1月30日	1月31日	1月31日	1月31日
券	+600	+700	+700	+900	+900	+800
財政	+14,600	+6,500	+6,500	+800	+800	+1,700
過不足	+15,200	+7,200	+7,200	+1,700	+1,700	
金融調節	エンド	スタート	エンド	スタート	スタート	スタート
国債買入				+10,400		
CP等買入	▲100	▲600	▲600			+4,000
国債補完供給	+33,500	+36,000	+36,000			
気候変動対応			▲28,300	+47,300		
当座預金増減	+12,600	+72,000	+72,000	+5,700	+5,700	
当座預金残高	5,406,000	5,478,000	5,478,000	5,483,700	5,483,700	
準備預金残高	4,715,800					主な需給要因
積み終了先	4,714,000					
超過準備	4,714,000					
非準備先残高	690,200					
準備預金進捗率	99.7%					
平均	45.2%					
乖離率	54.6%					

### 1月29日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
国債買入(1/30~)						
3~5年	4,250	11,596	4,254	0.006	0.007	94.0
5~10年	4,750	13,145	4,760	0.007	0.009	11.6
25年~	750	2,428	753	0.022	0.025	60.1
物価連動	600	2,770	602	▲0.720	▲0.863	23.2
国債補完供給(1/29~1/30)						
	36,285	36,285	▲0.350	▲0.350		
	1	1	▲0.350	▲0.350		

マナタリーベース	所要
1月26日時点	6,659,300

所要	所要
今積期の所要準備額	4,040,400
1月30日以降の残り所要	
積数	11,200
平均	700

### 国庫短期証券入札予定

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
1月30日	2年
2月1日	10年
2月5日	物価連動
2月7日	30年

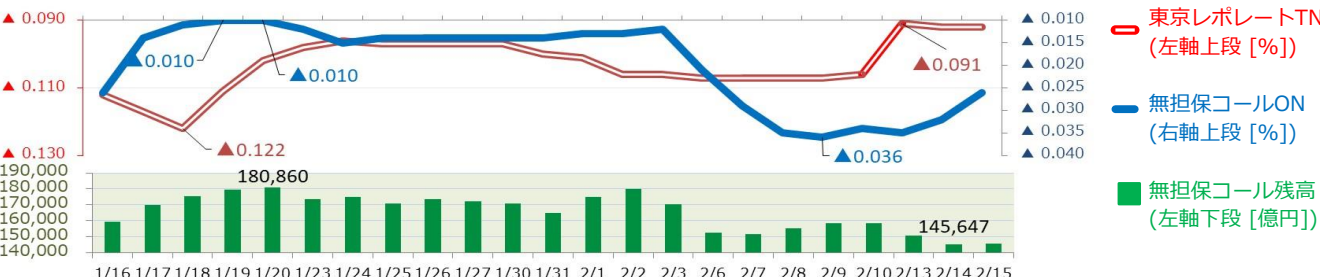
### 今月の国債買入オペ予定

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29日	0
5年超10年以下	4,000~9,000	4,750	15 19 24 29	1月29日	0
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29日	0
物価連動債	600	600	月1回	1月29日	0
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。