



短期市場の推移

[億円] [%]

	1月15日	1月16日	1月19日	1月20日
加重平均金利	0.727	0.727	0.727	0.728
東京レボレート(TN)	0.749	0.750	0.750	0.750
無コール残	88,061	87,578	91,563	95,913
ON	31,063	30,740	34,630	37,280
その他	56,998	56,838	56,933	58,633
有コール残	27,715	28,877	29,121	30,810

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 東京レボレート
	最低	最高	平均	
O/N	0.700	0.780	0.727	0.745
T/N	-	-	-	0.750
S/N	-	-	-	-
1W	0.720	0.810	0.727	0.742
2W	-	-	-	0.742
3W	-	-	-	0.742
1M	0.800	0.810	0.804	0.744
2M	-	-	-	-
3M	-	-	0.850	0.750
6M	-	-	-	0.802
1Y	-	-	-	0.912

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

資金需給

[億円]

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	1月21日	1月22日	1月21日	1月22日	1月21日	1月22日
券		+700		+800		+1,000
財政		▲14,700		+2,400		▲8,000
過不足		▲14,000		+3,200		▲7,000
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
国債買入				+8,000		
共通担保(全店)	▲8,000	+8,000				
CP等買入			▲100			
社債等買入	▲100		▲200			
国債補充供給	+2,100	▲2,800	+2,800			
当座預金増減		▲14,800		+13,700		▲7,000
当座預金残高		4,625,900		4,639,600		4,632,600
準備預金残高		4,249,100	主な需給要因			
積み終了先		4,241,100	流動性供給			
超過準備		4,239,000				
非準備先残高		376,800				
準備預金進捗率		99.0%				
平均		19.4%				
乖離率		79.7%				

国庫短期証券入札予定

1月22日	3ヶ月(第1358回)
1月30日	3ヶ月
2月6日	3ヶ月
2月9日	6ヶ月

国債入札予定	
1月26日	5年クライメート・トランジション
1月28日	40年
1月30日	2年
2月3日	10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	1000	1,000	7	1月7日	0
1年超3年以下	2700	2,700	7 15 21	1月21日	0
3年超5年以下	2450	2,450	7 21 29	1月21日	1
5年超10年以下	2600	2,600	15 21 29	1月21日	1
10年超25年以下	950	950	7 15 29	1月15日	1
25年超	750	750	15 21	1月21日	0
物価連動債	400	500	29	12月24日	1
変動利付債	-	300	-	4月14日	-

1月22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)		(米) 7~9月のGDP(2次速報値)		
	日銀金融政策決定会合(1日目)		(米) 個人消費支出(10~11月)		
	-		-		

本日の市況

無担保コールON物は0.727%の出合から始まり、その後も同程度で推移した。ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.001%の0.727%となった。

都銀・信託	証券	地銀
- ~ -	0.727 ~ 0.727	0.727 ~ 0.727

翌営業日のマーケット

出合いの水準は本日対比横ばい圏を予想する。

[%][億円]※米ドル資金供給は百万\$

1月21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(1/22~)						
1~3年	2,700	8,184	2,703	0.013	0.015	46.1
3~5年	2,450	5,180	2,455	0.003	0.004	66.7
5~10年	2,600	3,752	2,602	▲0.018	▲0.006	81.5
25年~	750	2,325	750	▲0.072	▲0.059	45.0
国債補充供給(1/21~1/22)						
	3,120	3,120	0.550	0.550		
	83	83	0.550	0.550		

マネタリーベース [億円]

1月20日時点 5,866,200

所要

今積期の所要準備額	4,133,500
1月22日以降の残り所要	
積数	39,600
平均	1,600

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