



短期市場の推移

	1月30日	1月31日	2月1日	2月2日
加重平均金利	▲0.014	▲0.014	▲0.013	▲0.013
東京レボレート(TN)	▲0.097	▲0.100	▲0.101	▲0.106
無コール残	170,786	165,187	174,928	179,939
ON	98,840	102,386	109,727	113,518
その他	71,946	62,801	65,201	66,421
有コール残	29,516	25,460	27,330	27,160

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	▲0.070	0.001	▲0.012	▲0.102
T/N	-	-	-	▲0.106
S/N	-	-	▲0.005	-
1W	-	-	▲0.035	▲0.118
2W	▲0.025	▲0.001	▲0.017	▲0.126
3W	-	-	▲0.005	▲0.136
1M	-	-	0.000	▲0.146
2M	-	-	-	-
3M	-	-	0.020	▲0.144
6M	-	-	-	▲0.103
1Y	-	-	-	▲0.080

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

2月6日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	-	-
-	-	-	-
-	-	-	-

経済指標及び予想値は株式会社フィスコ提供

本日の市況

本日の無担保コールON物は▲0.015%の合出から始まり、その後は主に▲0.020%~▲0.010%の水準で取引された。週末3日積みで一部ビットサイドの調達ニーズの強まりもみられ、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.001%の▲0.012%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.015 ~ ▲0.010	▲0.010 ~ ▲0.010	▲0.023 ~ ▲0.008

翌営業日のマーケット

オファービッド動向に大きな変化はなく出合いの水準は横ばいと予想する。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	2月3日	2月6日	2月6日	2月7日	2月7日	2月7日
券	+1,100	+600	+600	+1,000	+1,000	+1,000
財政	▲30,700	+6,200	+6,200	+5,000	+5,000	+5,000
過不足	▲29,600	+6,800	+6,800	+6,000	+6,000	+6,000
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				+15,900		
CP等買入	▲100		▲100			
国債補完供給	+67,800	▲58,500	+58,500			
当座預金増減	▲20,400	+81,100	+81,100	+6,000	+6,000	+6,000
当座預金残高	5,123,000	5,204,100	5,204,100	5,210,100	5,210,100	5,210,100
準備預金残高	4,454,500					
積み終了先	4,454,100					
超過準備	4,454,100					
非準備先残高	668,500					
準備預金進捗率	99.9%					
平均	67.7%					
乖離率	32.2%					

2月3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(固定利回り方式)(2/6~)						
5~10年	0	0				
5~10年	0	0				
国債買入(2/6~)						
~1年	1,500	4,490	1,502	▲0.009	▲0.006	78.3
1~3年	4,250	8,507	4,252	▲0.015	▲0.011	45.0
3~5年	5,000	9,200	5,003	▲0.013	▲0.010	54.8
10~25年	3,000	5,250	3,004	▲0.031	▲0.027	73.4
25年~	2,000	3,173	2,003	▲0.004	▲0.002	40.2
国債補完供給(2/3~2/6)						
	58,968	58,968	▲0.350	▲0.352		
	0	0				

マナタリーベース (億円)
2月2日時点 6,414,000

所要	(億円)
今積期の所要準備額	3,910,200
2月6日以降の残り所要	
積数	2,300
平均	200

国庫短期証券入札予定

2月9日	6ヶ月(第1137回)
2月10日	3ヶ月(第1138回)
2月16日	1年
2月17日	3ヶ月
2月7日	30年
2月9日	物価連動
2月16日	5年
2月21日	20年

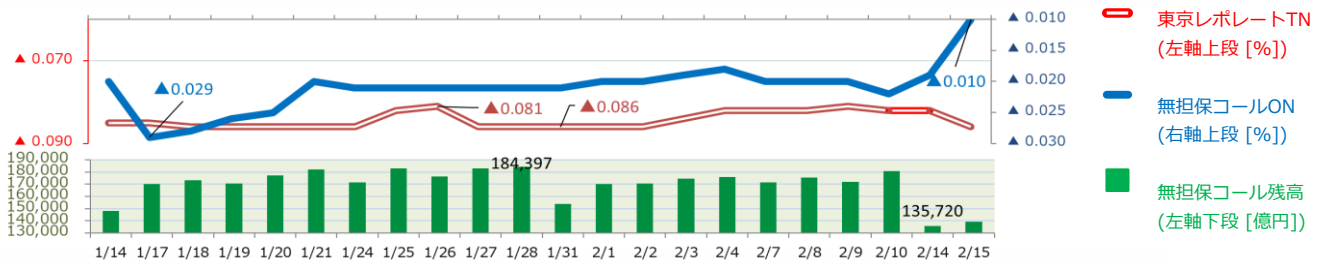
今月の国債買入オペ予定

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	2月3日	0
1年超3年以下	4,250~5,750	4,250	3 8 15 20	2月3日	3
3年超5年以下	5,000~6,500	5,000	3 8 20 27	2月3日	3
5年超10年以下	5,750~7,750	6,750	8 15 20 27	1月30日	4
10年超25年以下	2,000~4,000	3,000	3 8 15 27	2月3日	3
25年超	1,000~3,000	2,000	3 15 20	2月3日	2
物価連動債	600	600	月1回	1月30日	1
変動利付債<四半期>	300	300	四半期に1回	1月12日	-

1年前の市場推移

○2022年1月積み期 [1月14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