



短期市場の推移

	1月27日	1月28日	1月29日	1月30日
加重平均金利	0.476	0.477	0.477	0.477
東京レポレート(TN)	0.240	0.073	0.348	0.147
無コール残	79,248	79,026	80,441	84,972
ON	35,172	34,880	32,815	35,816
その他	44,076	44,146	47,626	49,156
有コール残	39,694	40,134	40,779	41,476

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	0.430	0.525	0.477	0.169
T/N	-	-	-	0.404
S/N	-	-	-	-
1W	0.640	0.650	0.643	0.373
2W	-	-	-	0.386
3W	-	-	-	0.400
1M	-	-	-	0.422
2M	-	-	-	-
3M	-	-	0.580	0.439
6M	-	-	-	0.472
1Y	-	-	-	0.550

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

2月3日の予定(時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
8:50	金融政策決定会合における 主な意見(1月23~24日)		(米)1月の製造業PMI (確報)	
	-		(欧)1月の製造業PMI (確報)	
	-		-	

本日の市況

無担保コールON物は0.477%の出合から始まり、その後は主に同水準を中心に取引された。ビットサイドの資金調達意欲は引き続き底堅く、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比横ばいの0.477%となった。

都銀・信託			証券	地銀
-	~	-	0.477 ~ 0.477	0.477 ~ 0.477

翌営業日のマーケット

ビットサイドの資金調達意欲は引き続き旺盛であるため、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31日	2月3日	2月3日	2月4日	2月4日
券		+1,400	+1,000	+1,000	+1,000
財政		+4,300	▲17,500	▲84,000	▲84,000
過不足		+5,700	▲16,500	▲83,000	▲83,000
金融調節	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド
国債買入		+4,400			
CP等買入	▲600	+2,000			
社債等買入	▲100				
国債補充供給	+7,100	▲5,100	+5,100		
当座預金増減		+13,400	▲11,400	▲83,000	▲83,000
当座預金残高		5,284,500	5,273,100	5,190,100	5,190,100
準備預金残高		4,744,500	主な需給要因		
積み終了先		4,743,700	国庫短期証券発行償還	法人税・消費税・保険	
超過準備		4,743,700	(3M)	料揚げ	
非準備先残高		540,000	国債発行償還(2年)		
準備預金進捗率		99.8%			
平均		58.1%			
乖離率		41.8%			

1月31日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
国債補充供給(1/31~2/3)	5,320	5,320	▲0.150	▲0.150		
	0	0				

マネタリーベース 【億円】
1月30日時点 6,522,500

所要	【億円】
今積期の所要準備額	4,074,100
2月3日以降の残り所要	
積数	6,400
平均	500

国庫短期証券入札予定

2月6日	6ヶ月(第1285回)
2月7日	3ヶ月(第1286回)
2月14日	3ヶ月
2月19日	1年
国債入札予定	
2月4日	10年
2月6日	30年
2月12日	物価連動
2月14日	5年

来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	3		1月15日 1
1年超3年以下	3000	3,000	3 7 13 19		1月28日 4
3年超5年以下	3000	3,000	3 7 19 26		1月28日 4
5年超10年以下	3250	3,250	7 13 19 26		1月30日 4
10年超25年以下	1500	1,500	3 13 26		1月28日 3
25年超	750	750	13 19		1月30日 2
物価連動債	500	600	26		1月30日 1
変動利付債	-	300	-		4月14日 -

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