



短期市場の推移

	2月1日	2月2日	2月3日	2月4日
加重平均金利	▲0.016	▲0.013	▲0.013	▲0.011
東京レポレート(TN)	▲0.085	▲0.085	▲0.084	▲0.085
無コール残	107,757	101,612	106,416	107,886
ON	64,434	58,089	61,583	63,733
その他	43,323	43,523	44,833	44,153
有コール残	20,189	20,748	22,881	21,074

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。

2月8日の予定 (時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
8:50	12月国際収支 (経常収支)	10229億円		-	
				-	
				-	

経済指標及び予想値は株式会社フィスコ提供

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	▲0.070	0.001	▲0.010	▲0.080
T/N	▲0.009	▲0.001	▲0.004	▲0.081
S/N	-	-	▲0.006	-
1W	▲0.010	▲0.008	▲0.008	▲0.085
2W	▲0.001	0.000	▲0.001	▲0.085
3W	-	-	-	▲0.090
1M	-	-	▲0.020	▲0.094
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.101
6M	-	-	-	▲0.111
1Y	-	-	-	▲0.138

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

本日の市況

本日の無担保コールON物は▲0.005%の出合から始まり、その後は主に▲0.010%~▲0.003%の水準で出合が見られた。引き続きビッドサイドの都銀・地銀の調達意欲は強く、同加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.001%の▲0.010%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.020 ~ ▲0.015	▲0.010 ~ ▲0.010	▲0.010 ~ ▲0.003

翌営業日のマーケット

ビッドサイドの動向に大きな変化はなく、出合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5日	2月8日	2月8日	2月9日	2月9日	2月9日
券	+700		+400		▲1,000	
財政	▲6,100		▲6,500		▲2,000	
過不足	▲5,400		▲6,100		▲3,000	
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				+6,700		
CP等買入	▲200		▲100			
社債等買入				+3,000		
E T F買入				+600		
国債補充供給	+300	▲400	+400			
当座預金増減	▲5,700		+4,500		▲3,000	
当座預金残高	4,856,300		4,860,800		4,857,800	
準備預金残高	4,295,500		主な需給要因			
積み終了先	4,295,500		国庫短期証券発行・	国債発行 (物国10		
超過準備	4,295,500		償還 (3M)	年)		
非準備先残高	560,800					
準備預金進捗率	99.9%					
平均	74.2%					
乖離率	25.7%					

2月5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
国債買入(2/8~)						
~1年	1,000	2,876	1,000	0.002	0.003	19.8
5~10年	4,200	10,213	4,209	▲0.003	▲0.002	95.3
10~25年	1,200	4,944	1,211	▲0.003	0.000	53.3
国債補充供給(2/5~2/8)						
	396	396	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マネタリーベース (億円)
 2月4日時点 6,066,300

所要	(億円)
今積期の所要準備額	3,617,200
2月8日以降の残り所要	
積数	100
平均	0

国庫短期証券入札予定

2月9日	6ヶ月	第971回
2月12日	3ヶ月	第972回
2月18日	1年	
2月19日	3ヶ月	
国債入札予定		
2月8日	物価連動	
2月16日	5年	
2月18日	20年	
2月26日	2年	

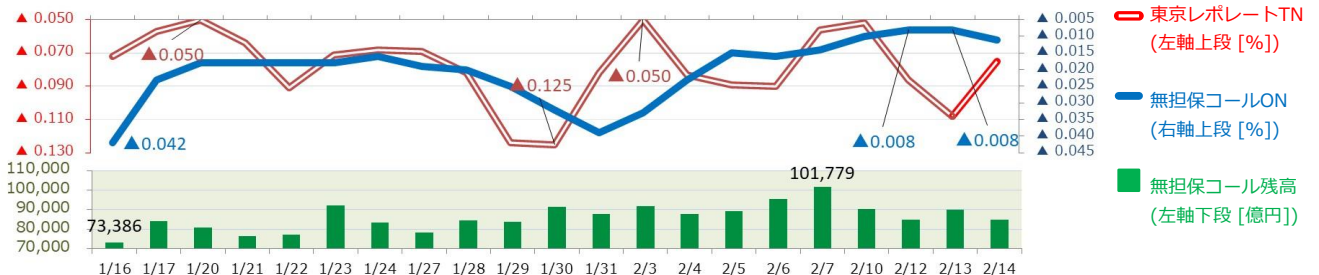
今月の国債買入オペ予定

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	500~1,500	1,000	2月2回程度	2月5日	1
1年超3年以下	2,500~5,500	4,000	3 9 15 19 25	2月3日	4
3年超5年以下	2,000~5,500	3,700	3 9 15 19 25	2月3日	4
5年超10年以下	2,500~6,000	4,200	5 9 15 19 25	2月5日	4
10年超25年以下	500~2,000	1,200	5 22	2月5日	1
25年超	0~500	300	9 22	1月29日	2
物価連動債	300	300	月2回程度	1月27日	2
変動利付債<回数>	500	500	月1回	12月7日	-

1年前の市場推移

○2020年1月積み期 [1月16日~2月14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ありません。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