



短期市場の推移

[億円] [%]

	1月25日	1月26日	1月27日	1月28日
加重平均金利	▲0.021	▲0.021	▲0.021	▲0.021
東京レポレート(TN)	▲0.082	▲0.081	▲0.086	▲0.086
無コール残	182,682	176,460	182,713	184,397
ON	101,849	95,837	101,780	105,104
その他	80,833	80,623	80,933	79,293
有コール残	17,578	17,466	17,736	17,287

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。

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	▲0.080	0.001	▲0.021	▲0.085
T/N	-	-	▲0.010	▲0.086
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.050	▲0.003	▲0.025	▲0.086
2W	▲0.010	▲0.003	▲0.008	▲0.087
3W	-	-	-	▲0.090
1M	▲0.005	▲0.001	▲0.005	▲0.094
2M	-	-	▲0.010	-
3M	-	-	-	▲0.103
6M	-	-	-	▲0.114
1Y	-	-	-	▲0.124

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1日の予定(時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
8:30	12月有効求人倍率	1.16倍	19:00	(欧)12月失業率	7.2%
8:30	12月失業率	+2.8%	23:45	(米)1月製造業PMI	
	1月製造業PMI			(米)1月ISM製造業指数	

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▲0.010%の合出から始まり、その後は主に▲0.040%~▲0.010%のレンジで推移した。ビットサイド動向に大きな変化はなく、本日の同加重平均金利(速報)は前営業日比横ばいの▲0.021%(速報)となった。

都銀・信託		証券	地銀
▲0.060 ~ ▲0.060		▲0.031 ~ ▲0.018	▲0.058 ~ ▲0.010

翌営業日のマーケット

地合いに大きな変化はなく、出合の水準は本日対比横ばい圏と予想。

資金需給

[億円]

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想
	1月31日		2月1日		2月2日
券	+400		+800		+1,000
財政	▲200		▲27,200		▲82,000
過不足	+200		▲26,400		▲81,000
金融調節	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド
共通担保(全店)	▲4,000		+5,000		▲3,000
CP等買入	+300		▲200		
国債補完供給	▲132,200		+123,500		
新型コロナ対応金融支援特別					
当座預金増減	▲7,400		▲26,200		▲84,000
当座預金残高	5,390,800		5,364,600		5,280,600
準備預金残高	4,775,600		4,775,200		4,775,200
積み終了先	4,775,200		4,775,200		4,775,200
超過準備	4,775,200		4,775,200		4,775,200
非準備先残高	615,200		615,200		615,200
準備預金進捗率	99.9%		99.9%		99.9%
平均	51.6%		51.6%		51.6%
乖離率	48.3%		48.3%		48.3%

1月31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
国債補完供給(1/31~2/1)	233	233	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マネタリーベース [億円]

1月28日時点 6,639,700

所要

[億円]

今積期の所要準備額	3,779,800
2月1日以降の残り所要	
積数	800
平均	100

国庫短期証券入札予定

2月4日	3ヶ月
2月9日	6ヶ月
2月10日	3ヶ月
2月17日	1年
2月1日	10年
2月3日	30年
2月8日	物価連動
2月15日	5年

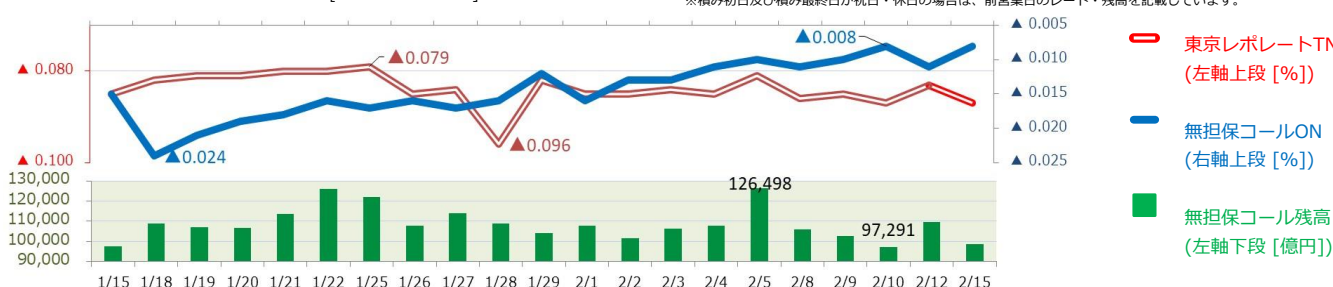
来月の国債買入オペ予定

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	月1回	1月11日	1
1年超3年以下	4500	4,500	2 9 16 21	1月20日	4
3年超5年以下	4500	4,500	2 9 21 24	1月26日	4
5年超10年以下	4250	4,250	9 16 21 24	1月26日	4
10年超25年以下	1500	1,500	2 9 16 21 24	1月6日	1
25年超	500	500	16	1月17日	1
物価連動債	600	600	月1回	1月26日	1
変動利付債<四半期>	300	300	四半期に1回	1月20日	-

1年前の市場推移

○2021年1月積み期 [1月15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