



短期市場の推移

	1月26日	1月27日	1月28日	1月31日
加重平均金利	▲0.021	▲0.021	▲0.021	▲0.021
東京レボレート(TN)	▲0.081	▲0.086	▲0.086	▲0.086
無コール残	176,460	182,713	184,397	153,825
ON	95,837	101,780	105,104	81,872
その他	80,623	80,933	79,293	71,953
有コール残	17,466	17,736	17,287	17,056

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	▲0.080	0.001	▲0.020	▲0.085
T/N	-	-	▲0.010	▲0.086
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.050	▲0.005	▲0.032	▲0.087
2W	▲0.040	0.200	▲0.014	▲0.087
3W	-	-	-	▲0.090
1M	-	-	0.000	▲0.094
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.102
6M	-	-	-	▲0.114
1Y	-	-	-	▲0.124

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2日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
マネタリーベース(1月)		19:00 (欧)1月消費者物価コア指数[前年比]	1.7%
-		-	-
-		-	-

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。オファーサイド・ビッドサイドとも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+0.001%の▲0.020%(速報)となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.055 ~ ▲0.055	▲0.025 ~ ▲0.020	▲0.050 ~ ▲0.010

翌営業日のマーケット

都合い大きな変化はなく、出合の水準は本日対比横ばい圏と予想。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想
	2月1日	2月2日	2月1日	2月2日	2月3日
券	+700		+600		+0
財政	▲29,300		▲101,500		+1,000
過不足	▲28,600		▲100,900		+1,000
金融調節	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド
国庫短期証券買入				+5,000	
共通担保(全店)			▲3,000	+2,800	
国債補完供給	+200	▲100	+100		
当座預金増減	▲28,500		▲96,000		+1,000
当座預金残高	5,362,300		5,266,300		5,267,300
準備預金残高	4,747,600				
積み終了先	4,747,300				
超過準備	4,747,300				
非準備先残高	614,700				
準備預金進捗率	99.9%				
平均	54.8%				
乖離率	45.1%				

2月1日のオペ結果

オペ種類 オファー 応札 落札 足切 平均 按分

国庫短期証券買入(2/2~)	5,000	20,279	5,002	0.005	0.006	75.3
----------------	-------	--------	-------	-------	-------	------

米ドル資金供給(2/3~2/10)	0	0	0.340	0.340
-------------------	---	---	-------	-------

国債補完供給(2/1~2/2)	86	86	▲0.350	▲0.350
-----------------	----	----	--------	--------

共通担保(全店)(2/2~2/16)	20,000	2,781	2,781
--------------------	--------	-------	-------

マネタリーベース (億円)	所要 (億円)
1月31日時点 6,631,900	今積期の所要準備額 3,779,800
	2月2日以降の残り所要積数 400
	平均 0

国庫短期証券入札予定

2月4日	3ヶ月(第1056回)
2月9日	6ヶ月
2月10日	3ヶ月
2月17日	1年

国債入札予定

2月3日	30年
2月8日	物価連動
2月15日	5年
2月17日	20年

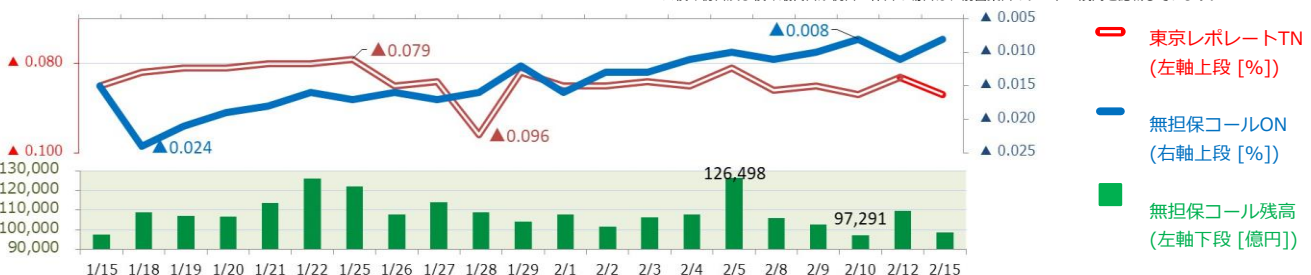
今月の国債買入オペ予定

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	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	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