



短期市場の推移

	1月28日	1月31日	2月1日	2月2日
加重平均金利	▲0.021	▲0.021	▲0.020	▲0.020
東京レポレート(TN)	▲0.086	▲0.086	▲0.086	▲0.086
無コール残	184,397	153,825	170,015	170,690
ON	105,104	81,872	98,404	97,269
その他	79,293	71,953	71,611	73,421
有コール残	17,287	17,056	29,477	29,153

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	0.010	▲0.019	▲0.083
T/N	▲0.013	▲0.010	▲0.011	▲0.084
S/N	-	-	▲0.005	-
1W	▲0.007	▲0.006	▲0.007	▲0.085
2W	-	-	▲0.040	▲0.086
3W	-	-	-	▲0.089
1M	▲0.010	0.000	▲0.006	▲0.094
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.102
6M	-	-	-	▲0.114
1Y	-	-	-	▲0.124

無担保コール(速報)は日銀、東京レポレートは日本証券業協会公表

2月4日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	0:00 (米)1月ISM非製造業景況指数	60.0
-	-	22:30 (米)1月失業率	3.9%
-	-	-	-

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%の合から始まり、その後は主に▲0.040%~▲0.010%のレンジで推移した。マーケットの地合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▲0.019%(速報)となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.040 ~ ▲0.040	▲0.020 ~ ▲0.015	▲0.040 ~ ▲0.010

翌営業日のマーケット

週末3日積み要因により、出合の水準は本日対比で上昇すると予想。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	2月3日		2月4日		2月7日	
券	▲300		+500		+1,000	
財政	▲1,300		▲5,000		+8,000	
過不足	▲1,600		▲4,500		+9,000	
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		+12,100				
CP等買入	▲100		▲300			
社債等買入			▲100			
国債補完供給	+600	▲200	+200			
当座預金増減	+10,800		▲4,700		+9,000	
当座預金残高	5,273,600		5,268,900		5,277,900	
準備預金残高	4,675,000		主な需給要因			
積み終了先	4,675,000		国債発行(30年)		国庫短期証券	
超過準備	4,675,000		発行償還(3M)			
非準備先残高	598,600					
準備預金進捗率	99.9%					
平均	61.3%					
乖離率	38.6%					

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
国債補完供給(2/3~2/4)	166	166	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マナリーベース (億円)
2月2日時点 6,502,500

所要	(億円)
今積期の所要準備額	3,779,800
2月4日以降の残り所要	
積数	200
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(第1057回)
2月10日	3ヶ月(第1058回)
2月17日	1年

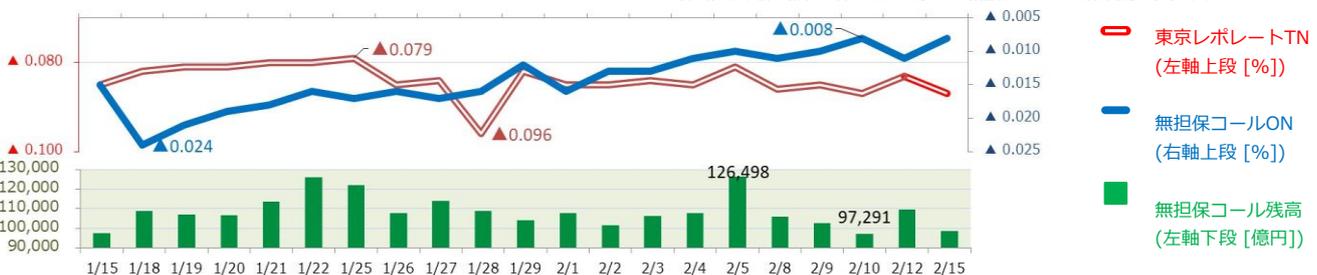
今月の国債買入オペ予定

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2日	0
1年超3年以下	4500	4,500	2 9 16 21	2月2日	3
3年超5年以下	4500	4,500	2 9 21 24	2月2日	3
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	2月2日	0
25年超	500	500	16	1月17日	1
物価運動債	600	600	月1回	1月26日	-
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