



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	▲0.020	▲0.020	▲0.019	▲0.018
東京レポレート(TN)	▲0.086	▲0.086	▲0.084	▲0.082
無コール残	170,015	170,690	174,671	175,764
ON	98,404	97,269	99,700	103,093
その他	71,611	73,421	74,971	72,671
有コール残	29,477	29,153	29,015	29,701

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	▲0.020	▲0.081
T/N	-	-	-	▲0.082
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.003	0.050	0.008	▲0.083
2W	▲0.013	0.000	▲0.008	▲0.086
3W	-	-	-	▲0.088
1M	▲0.005	0.200	0.098	▲0.093
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)	1011億円	22:30	(米)12月貿易収支	-831億米ドル

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▲0.01%の出合から始まり、その後は主に▲0.040%~▲0.008%のレンジで推移した。先週に引き続き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▲0.002%の▲0.02% (速報) となった。

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

翌営業日のマーケット

出合の水準は本日対比横ばい圏での推移を予想。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	2月7日		2月8日		2月9日	
券	+500		+300		+0	
財政	▲3,400		▲1,900		▲2,000	
過不足	▲2,900		▲1,600		▲2,000	
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
CP等買入	▲300		▲100			
社債等買入						+1,300
E T F 買入		+700				
国債補完供給	+100	▲100	+100			
当座預金増減	▲2,500		▲1,600		▲700	
当座預金残高	5,266,700		5,265,100		5,264,400	
準備預金残高	4,668,300		主な需給要因			
積み終了先	4,668,300		国債発行(物運)			
超過準備	4,668,300					
非準備先残高	598,400					
準備預金進捗率	99.9%					
平均	74.2%					
乖離率	25.7%					

2月7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(2/7~2/8)	96	96	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マネタリーベース (億円)
2月4日時点 6,508,600

所要	(億円)
今積期の所要準備額	3,777,100
2月8日以降の残り所要	
積数	100
平均	0

国債短期証券入札予定

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
2月18日	3ヶ月

国債入札予定

2月8日	物価運動
2月15日	5年
2月17日	20年
2月25日	2年

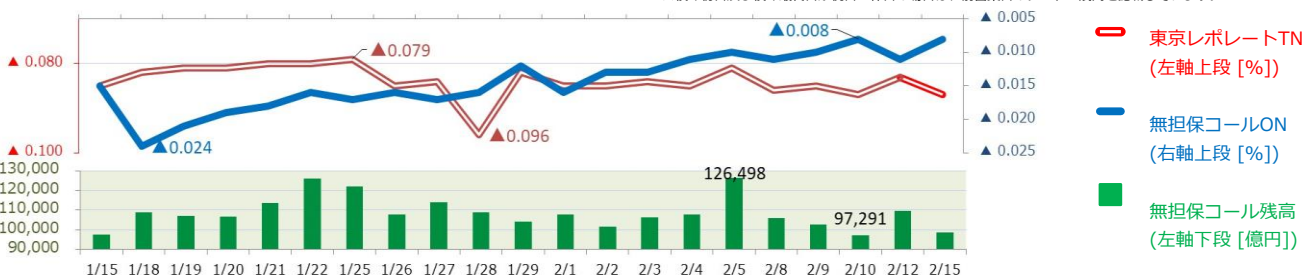
今月の国債買入オペ予定

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	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