



短期市場の推移

	2月3日	2月4日	2月7日	2月8日
加重平均金利	▲0.019	▲0.018	▲0.020	▲0.020
東京レポレート(TN)	▲0.084	▲0.082	▲0.082	▲0.082
無コール残	174,671	175,764	171,550	175,373
ON	99,700	103,093	102,009	107,242
その他	74,971	72,671	69,541	68,131
有コール残	29,015	29,701	29,145	28,944

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	▲0.080
T/N	-	-	▲0.015	▲0.081
S/N	-	-	▲0.005	-
1W	▲0.005	▲0.003	▲0.004	▲0.082
2W	-	-	-	▲0.086
3W	-	-	-	▲0.088
1M	▲0.010	▲0.007	▲0.009	▲0.093
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.102
6M	-	-	-	▲0.114
1Y	-	-	-	▲0.123

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10日の予定 (時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
8:50	1月国内企業物価指数 [前年比]	+8.2%	22:30	(米)1月消費者物価コア指数 [前年比]	5.9%
	-	-	22:30	(米)新規失業保険申請件数 [前週分]	-
	-	-		(英)中央銀行総裁講演	-

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%~▲0.010%のレンジで推移した。出合の水準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▲0.020%(速報)となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.035 ~ ▲0.035	▲0.020 ~ ▲0.020	▲0.040 ~ ▲0.010

翌営業日のマーケット

週末4日積みである明日についてもビッドサイド動向に大きな変化はなく、出合の水準は本日対比横ばい圏での推移を予想する。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想
	2月9日		2月10日		2月14日
券	+200		+100		+0
財政	▲400		+7,800		▲24,000
過不足	▲200		+7,900		▲24,000
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			
国債買入				+13,200	
CP等買入				▲700	
社債等買入		+1,300			
国債補充供給	+100	▲200	+200		
当座預金増減	+6,000		+20,600		▲24,000
当座預金残高	5,267,100		5,287,700		5,263,700
準備預金残高	4,672,800		4,672,800		4,672,800
積み終了先	4,672,800		国庫短期証券発行・償還(6M)		国庫短期証券発行・償還(3M)
超過準備	4,672,800				
非準備先残高	594,300				
準備預金進捗率	99.9%				
平均	80.6%				
乖離率	19.3%				

2月9日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
国債買入(2/10~)						
1~3年	4,500	13,113	4,503	0.002	0.004	40.4
3~5年	4,500	8,814	4,503	▲0.002	0.000	20.1
5~10年	4,250	8,345	4,256	▲0.005	▲0.003	51.2
国債補充供給(2/9~2/10)						
	153	153	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マナリーベース (億円)
2月8日時点 6,499,700

所要	(億円)
今積期の所要準備額	3,777,100
2月10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10日	3ヶ月(第1058回)
2月17日	1年
2月18日	3ヶ月
2月24日	6ヶ月
2月15日	5年
2月17日	20年
2月25日	2年
2月1日	10年

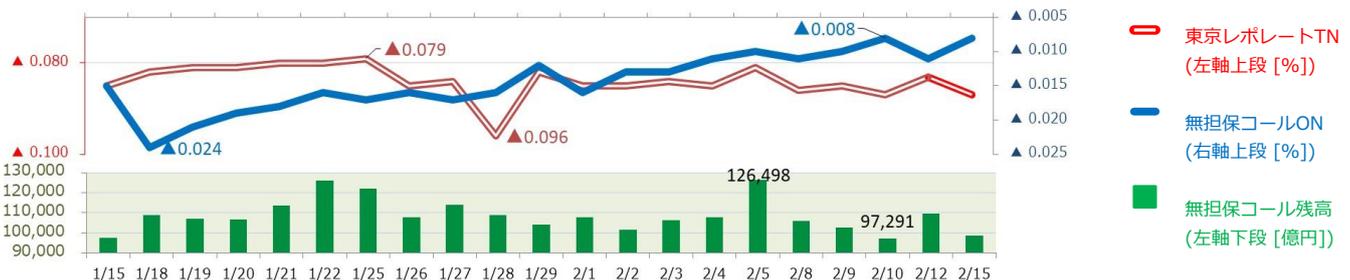
今月の国債買入オペ予定

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月9日	2月9日	2
3年超5年以下	4500	4,500	2月9日	2月9日	2
5年超10年以下	4250	4,250	2月9日	2月9日	3
10年超25年以下	1500	1,500	2月2日	2月2日	0
25年超	500	500	1月17日	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