



### 短期市場の推移

	1月26日	1月27日	1月30日	1月31日
加重平均金利	▲0.014	▲0.014	▲0.014	▲0.014
東京レボレート(TN)	▲0.097	▲0.097	▲0.097	▲0.100
無コール残	173,553	172,193	170,786	165,187
ON	103,507	100,247	98,840	102,386
その他	70,046	71,946	71,946	62,801
有コール残	32,248	30,165	29,516	25,460

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	▲0.070	0.001	▲0.013	▲0.099
T/N	-	-	-	▲0.101
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.025	▲0.020	▲0.023	▲0.116
2W	▲0.030	0.040	▲0.018	▲0.126
3W	-	-	-	▲0.137
1M	-	-	-	▲0.144
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.144
6M	-	-	-	▲0.103
1Y	-	-	-	▲0.079

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
-	-	4:00 (米)2月連邦公開市場委員会 (FOMC)政策金利	4.75%
-	-	22:30 (米)新規失業保険申請件数 [前週分]	-
-	-	-	-

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▲0.012%の割合から始まり、その後は主に▲0.020%~▲0.010%の水準で取引された。大手行中心に資金調達ニーズは強く、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.001%の▲0.013%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.015 ~ ▲0.012	- ~ -	▲0.025 ~ ▲0.012

### 翌営業日のマーケット

ビッドサイドの動向は変化せず、出合水準は本日対比横ばい圏を予想する。

### 資金需給

	日銀速報	日銀予想	当社需給予想
	2月1日	2月2日	2月3日
券	+700	+0	▲2,000
財政	▲37,700	▲84,000	▲27,000
過不足	▲37,000	▲84,000	▲29,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国庫短期証券買入	+1,000		
国債買入	+400		
共通担保(全店)	+10,000		
CP等買入		▲200	
国債補充供給	+73,400	▲70,000	+70,000
当座預金増減	▲22,200	▲14,200	▲29,000
当座預金残高	5,225,400	5,211,200	5,182,200
準備預金残高	4,549,400	主な需給要因	
積み終了先	4,548,800	法人税揚げ	国債発行(10年)
超過準備	4,548,500		
非準備先残高	676,000		
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

【%】(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
国債買入(固定利回り方式)(2/2~)						
5~10年	0	0				
5~10年	0	0				
国債補充供給(2/1~2/2)						
	70,448	70,274	▲0.350	▲0.360		
	319	319	▲0.350	▲0.358		

マネタリーベース (億円)  
1月31日時点 6,519,000

所要	(億円)
今積期の所要準備額	3,910,200
2月2日以降の残り所要	
積数	3,800
平均	300

### 国庫短期証券入札予定

2月3日	3ヶ月(第1136回)
2月9日	6ヶ月
2月10日	3ヶ月
2月16日	1年

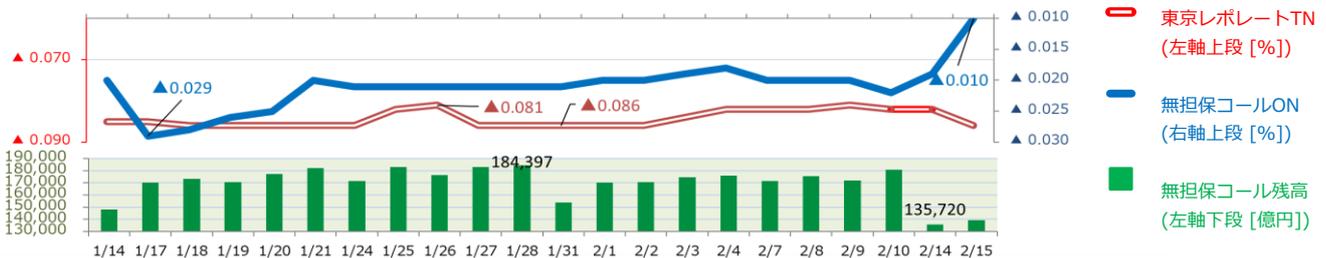
### 今月の国債買入オペ予定

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	1月6日	1
1年超3年以下	4,250~5,750	5,000	3 8 15 20	1月25日	4
3年超5年以下	5,000~6,500	5,000	3 8 20 27	1月30日	4
5年超10年以下	5,750~7,750	6,750	8 15 20 27	1月30日	4
10年超25年以下	2,000~4,000	4,000	3 8 15 27	1月30日	4
25年超	1,000~3,000	2,000	3 15 20	1月30日	3
物価連動債	600	600	月1回	1月30日	1
変動利付債<四半期>	300	300	四半期に1回	1月12日	0

### 1年前の市場推移

○2022年1月積み期 [1月14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