



	1月27日	1月30日	1月31日	2月1日
加重平均金利	▲0.014	▲0.014	▲0.014	▲0.013
東京レポレート(TN)	▲0.097	▲0.097	▲0.100	▲0.101
無コール残	172,193	170,786	165,187	174,928
ON	100,247	98,840	102,386	109,727
その他	71,946	71,946	62,801	65,201
有コール残	30,165	29,516	25,460	27,330

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	▲0.070	0.001	▲0.013	▲0.100
T/N	-	-	-	▲0.106
S/N	-	-	▲0.005	-
1W	-	-	0.008	▲0.118
2W	▲0.030	▲0.012	▲0.023	▲0.127
3W	-	-	-	▲0.136
1M	▲0.020	0.160	0.006	▲0.146
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.145
6M	-	-	-	▲0.103
1Y	-	-	-	▲0.080

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3日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	22:30 (米)1月非農業部門雇用者数	17.5万人
-	-	22:30 (米)1月失業率	3.6%
-	-	22:30 (米)1月平均時給[前年比]	4.3%

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%の出合から始まり、その後は主に▲0.020%~▲0.010%の水準で取引された。昨日と同様に資金調達ニーズは底堅く、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比横ばいの▲0.013%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.015 ~ ▲0.011	▲0.012 ~ ▲0.010	▲0.025 ~ ▲0.010

翌営業日のマーケット

3日積みのため、ビッドサイドの調達ニーズが強く、出合い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2日		2月3日		2月6日	
券	+100		+1,000		+1,000	
財政	▲84,100		▲31,300		+0	
過不足	▲84,000		▲30,300		+1,000	
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	▲200		▲100			
国債補充供給	+70,000	▲67,800	+67,800			
当座預金増減	▲82,000		+37,400		+1,000	
当座預金残高	5,143,400		5,180,800		5,181,800	
準備預金残高	4,472,000		主な需給要因			
積み終了先	4,471,600		国債発行(10年)		国庫短期証券	
超過準備	4,471,600		発行・償還(3M)			
非準備先残高	671,400					
準備預金進捗率	99.9%					
平均	58.1%					
乖離率	41.8%					

2月2日のオペ結果

[%][徳円] ※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)(2/3~)						
5~10年	0	0				
5~10年	0	0				
国債補充供給(2/2~2/3)						
	68,107	67,125	▲0.350	▲0.374		
	994	994	▲0.350	▲0.351		

マネタリーベース [徳円]  
2月1日時点 6,496,100

所要	[徳円]
今積期の所要準備額	3,910,200
2月3日以降の残り所要	
積数	3,400
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(第1137回)
2月10日	3ヶ月
2月16日	1年

国債入札予定

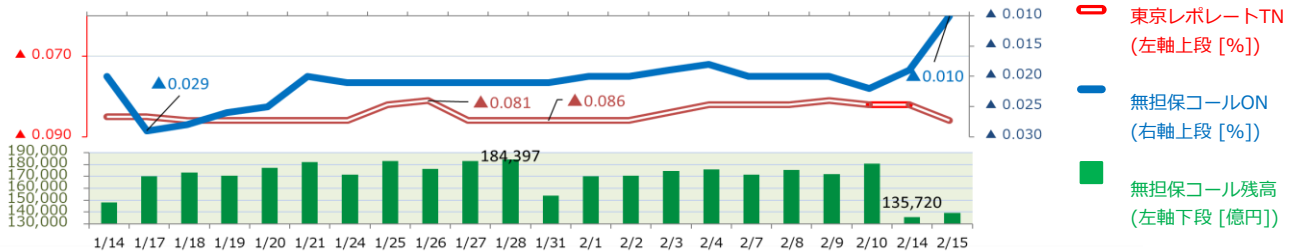
2月7日	30年
2月9日	物価連動
2月16日	5年
2月21日	20年

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