



短期市場の推移

	2月1日	2月2日	2月3日	2月6日
加重平均金利	▲0.013	▲0.013	▲0.012	▲0.021
東京レポレート(TN)	▲0.101	▲0.106	▲0.106	▲0.107
無コール残	174,928	179,939	170,535	152,823
ON	109,727	113,518	103,544	87,361
その他	65,201	66,421	66,991	65,462
有コール残	27,330	27,160	27,038	28,959

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	▲0.029	▲0.101
T/N	-	-	▲0.006	▲0.107
S/N	-	-	▲0.005	-
1W	-	-	0.001	▲0.116
2W	▲0.040	0.000	▲0.031	▲0.126
3W	-	-	-	▲0.137
1M	-	-	-	▲0.144
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.146
6M	-	-	-	▲0.107
1Y	-	-	-	▲0.081

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)	12493億円		-	
				-	
				-	

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▲0.030%の合出から始まり、その後は主に▲0.040%~▲0.020%の水準で取引された。ビッドサイドの調達意欲の弱まりも見られ、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.008%の▲0.029%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.040 ~ ▲0.035	- ~ -	▲0.040 ~ ▲0.015

翌営業日のマーケット

引き続き調達意欲の弱まりも想定されるなか、出合水準は本日対比低下を予想する。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	2月7日	2月8日	2月8日	2月9日	2月9日	2月9日
券		+1,100	+500	▲2,000		
財政		+600	▲7,600	+7,000		
過不足		+1,700	▲7,100	+5,000		
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
国庫短期証券買入			+1,000			
国債買入			+100			
共通担保(全店)			▲5,800	+2,800		
CP等買入	▲200		▲100			
国債補充供給	+58,800	▲53,500	+53,500			
当座預金増減		+6,800	+44,400	+5,000		
当座預金残高		5,147,900	5,192,300	5,197,300		
準備預金残高		4,474,800				
積み終了先		4,474,700	国債発行 (30年)			
超過準備		4,474,300				
非準備預金先高		673,100				
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
国庫短期証券買入(2/8~)	1,000	3,341	1,000	0.012	0.014	8.0
国債買入(固定利回り方式)(2/8~)						
5~10年		70	70			
5~10年		0	0			
米ドル資金供給(2/9~2/16)						
	2	2	4.830	4.830		
国債補充供給(2/7~2/8)						
	53,739	53,739	▲0.350	▲0.351		
	0	0				
米ドル資金供給用担保国債供給(2/8~2/17)						
	5,000	2	2	▲0.100	▲0.100	

マネタリーベース [億円]
2月6日時点 6,409,900

所要	[億円]
今積期の所要準備額	3,906,000
2月8日以降の残り所要	
積数	400
平均	100

国庫短期証券入札予定

2月9日	6ヶ月(第1137回)
2月10日	3ヶ月(第1138回)
2月16日	1年
2月17日	3ヶ月

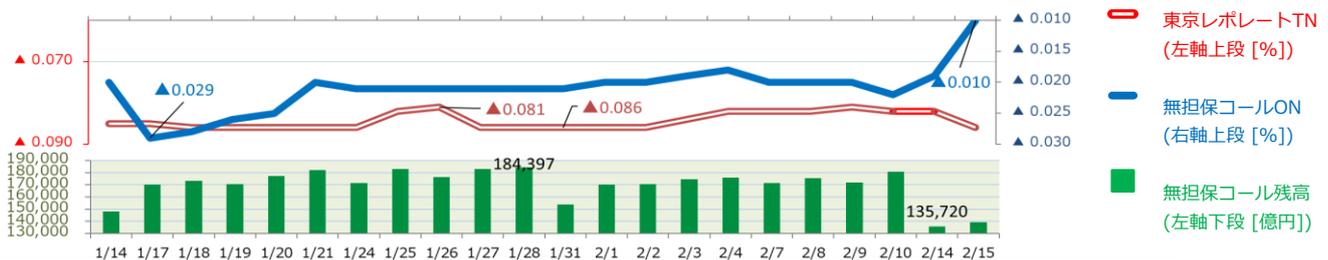
今月の国債買入オペ予定

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3日	0
1年超3年以下	4,250~5,750	4,250	3 8 15 20	2月3日	3
3年超5年以下	5,000~6,500	5,000	3 8 20 27	2月3日	3
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	3,000	3 8 15 27	2月3日	3
25年超	1,000~3,000	2,000	3 15 20	2月3日	2
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	-

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