



短期市場の推移

	2月3日	2月6日	2月7日	2月8日
加重平均金利	▲0.012	▲0.021	▲0.029	▲0.035
東京レポレート(TN)	▲0.106	▲0.107	▲0.107	▲0.107
無コール残	170,535	152,823	151,888	155,626
ON	103,544	87,361	85,976	88,479
その他	66,991	65,462	65,912	67,147
有コール残	27,038	28,959	26,755	26,986

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	▲0.073	0.001	▲0.036	▲0.102
T/N	-	-	▲0.007	▲0.107
S/N	-	-	▲0.015	-
1W	▲0.038	0.008	▲0.028	▲0.116
2W	-	-	-	▲0.126
3W	-	-	▲0.001	▲0.138
1M	-	-	-	▲0.147
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.147
6M	-	-	-	▲0.106
1Y	-	-	-	▲0.082

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]	+9.7%		-	
				-	
				-	

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▲0.035%の合出から始まり、その後は主に▲0.045%~▲0.034%の水準で取引された。ビッドサイドの調達意欲に大きな変化はなく、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.001%の▲0.036%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.045 ~ ▲0.040	▲0.040 ~ ▲0.040	▲0.040 ~ ▲0.034

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なることを見込まれ、出合い水準は本日対比で若干上昇すると予想

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	2月9日	2月10日	2月9日	2月10日	2月13日	2月14日
券	+400		+200		▲1,000	
財政	+400		▲4,200		+7,000	
過不足	+800		▲4,000		+6,000	
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
国債買入		+19,200		+300		
CP等買入				▲500		
国債補完供給	+52,000	▲55,100	+55,100			
当座預金増減	+16,900		+50,900		+6,000	
当座預金残高	5,155,300		5,206,200		5,212,200	
準備預金残高	4,488,500		主な需給要因			
積み終了先	4,488,500		国債発行(物価連動)	国庫短期証券発行・償還(3M)		
超過準備	4,488,400		国庫短期証券発行・償還(6M)			
非準備先残高	666,800					
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(固定利回り方式)(2/10~)						
5~10年	280	280				
5~10年	0	0				
国債補完供給(2/9~2/10)						
	55,130	55,130	▲0.350	▲0.351		
	271	271	▲0.350	▲0.352		

マネタリーベース (億円)

2月8日時点 6,405,600

所要

今積期の所要準備額	3,906,000
2月10日以降の残り所要	
積数	200
平均	0

国庫短期証券入札予定

2月10日	3ヶ月(第1138回)
2月16日	1年(第1139回)
2月17日	3ヶ月
2月24日	3ヶ月

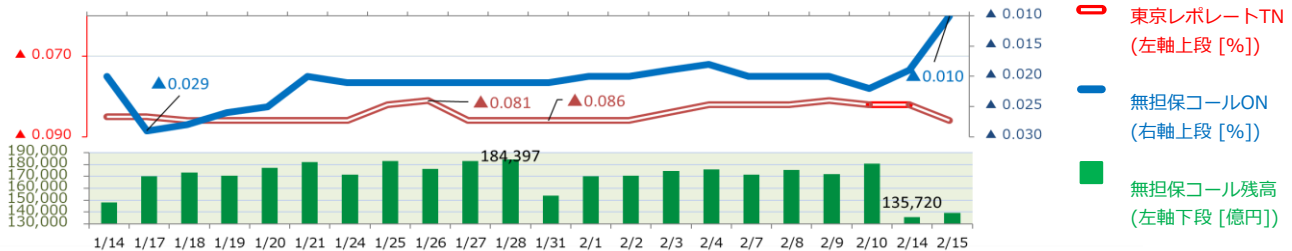
今月の国債買入オペ予定

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8日	2
3年超5年以下	5,000~6,500	5,000	3 8 20 27	2月8日	2
5年超10年以下	5,750~7,750	6,750	8 15 20 27	2月8日	3
10年超25年以下	2,000~4,000	3,000	3 8 15 27	2月8日	2
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