



短期市場の推移

	1月25日	1月26日	1月29日	1月30日
加重平均金利	▲0.012	▲0.010	▲0.011	▲0.011
東京レボレート(TN)	▲0.080	▲0.081	▲0.081	▲0.086
無コール残	172,360	170,082	179,881	167,843
ON	76,187	74,949	88,953	75,870
その他	96,173	95,133	90,928	91,973
有コール残	28,077	26,931	29,409	29,521

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	▲0.087	0.001	▲0.011	▲0.082
T/N	-	-	▲0.007	▲0.084
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.019	0.001	▲0.014	▲0.091
2W	▲0.017	▲0.015	▲0.016	▲0.097
3W	-	-	-	▲0.102
1M	▲0.002	0.001	▲0.001	▲0.107
2M	-	-	-	-
3M	0.020	0.025	0.023	▲0.123
6M	-	-	-	▲0.093
1Y	-	-	-	▲0.061

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1日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	(米)新規失業保険申請件数	-
-	-	-	-
-	-	-	-

本日の市況

無担保コールON物は▲0.008%の合出から始まり、その後は主に▲0.012%~▲0.005%を中心に取引された。オファービッド共に動向に大きな変化はなく、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比横ばいの▲0.011%となった。

都銀・信託	証券	地銀
- ~ -	- ~ -	▲0.014 ~ ▲0.005

翌営業日のマーケット

引き続きビッドサイドの資金調達意欲は底堅く、出合の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	
	1月31日	2月1日	2月1日	2月2日	2月2日	2月2日
券	+700	+300	+300	+1,000	+1,000	+1,000
財政	▲3,500	▲29,400	▲29,400	▲104,000	▲104,000	▲104,000
過不足	▲2,800	▲29,100	▲29,100	▲103,000	▲103,000	▲103,000
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				
CP等買入	▲2,000	+4,000				
国債補完供給	+38,000	▲36,200	+36,200			
当座預金増減	+2,000	+7,100	+7,100	▲103,000	▲103,000	▲103,000
当座預金残高	5,436,900	5,444,000	5,444,000	5,341,000	5,341,000	5,341,000
準備預金残高	4,727,900					
積み終了先	4,726,800	国債発行償還(2年)	国債発行(10年)			
超過準備	4,726,500		法人税・消費税・保険 揚げ			
非準備先残高	709,000					
準備預金進捗率	99.8%					
平均	51.6%					
乖離率	48.2%					

1月31日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
国債補完供給(1/31~2/1)	36,522	36,522	▲0.350	▲0.350		
	11	11	▲0.350	▲0.350		

マネタリーベース (億円)
1月30日時点 6,699,500

所要	(億円)
今積期の所要準備額	4,040,400
2月1日以降の残り所要	
積数	8,500
平均	600

国庫短期証券入札予定

2月2日	3ヶ月(第1210回)
2月8日	6ヶ月
2月9日	3ヶ月
2月16日	3ヶ月

国債入札予定

2月1日	10年
2月5日	物価連動
2月7日	30年
2月9日	5年

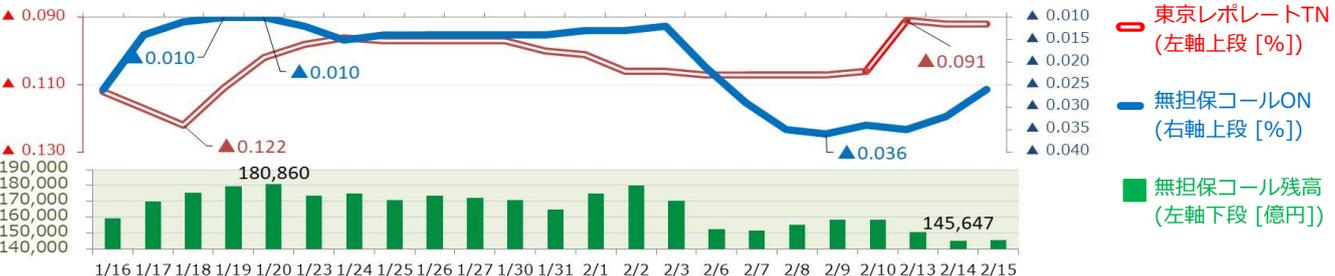
来月の国債買入オペ予定

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15日	1
1年超3年以下	3,000~6,500	3,750	2 8 15 21	1月24日	4
3年超5年以下	3,500~7,500	4,250	2 8 15 21	1月29日	4
5年超10年以下	4,000~9,000	4,750	2 8 21 28	1月29日	4
10年超25年以下	1,000~5,000	1,500	8 15 28	1月24日	3
25年超	500~3,500	750	15 28	1月29日	2
物価連動債	600	600	月1回	1月29日	1
変動利付債	-	300	-	4月14日	-

1年前の市場推移

○2023年1月積み期 [1月16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