



短期市場の推移

	1月29日	1月30日	1月31日	2月1日
加重平均金利	▲0.011	▲0.011	▲0.011	▲0.010
東京レボレート(TN)	▲0.081	▲0.086	▲0.084	▲0.080
無コール残	179,881	167,843	149,610	156,433
ON	88,953	75,870	72,192	73,675
その他	90,928	91,973	77,418	82,758
有コール残	29,409	29,521	29,366	30,079

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	▲0.008	▲0.070
T/N	-	-	▲0.005	▲0.071
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	▲0.020	▲0.081
2W	▲0.015	0.200	0.013	▲0.088
3W	-	-	-	▲0.096
1M	▲0.002	0.001	0.000	▲0.103
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.123
6M	-	-	-	▲0.093
1Y	-	-	-	▲0.057

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5日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	(米) サービス業PMI (1月)	-
-	-	(米) ISM非製造業指数 (1月)	-
-	-	(欧) サービス業PMI (1月)	-

本日の市況

無担保コールON物は▲0.006%の出合から始まり、その後は主に▲0.007%~▲0.003%を中心に取引された。週末3日積み要因により、ビッドサイドの調達意欲が旺盛となり、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比0.002%上昇の▲0.008%となった。

都銀・信託	証券	地銀
- ~ -	- ~ -	▲0.010 ~ ▲0.003

翌営業日のマーケット

3日積み要因は剥落するが、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這い圏を予想する。

資金需給

	日銀速報	日銀予想	当社需給予想
	2月2日	2月5日	2月6日
券	+800	+900	+1,000
財政	▲101,600	▲2,000	▲3,000
過不足	▲100,800	▲1,100	▲2,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国債買入			+14,600
CP等買入	▲300	▲100	
国債補完供給	+34,300	▲33,300	+33,300
当座預金増減	▲100,100	+46,700	▲2,000
当座預金残高	5,302,800	5,349,500	5,347,500
準備預金残高	4,624,700	主な需給要因	
積み終了先	4,623,700	国債発行(物連10年)	
超過準備	4,623,700		
非準備先残高	678,100		
準備預金進捗率	99.9%		
平均	64.5%		
乖離率	35.4%		

2月2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(2/5~)						
~1年	1,500	4,336	1,500	0.011	0.013	74.4
1~3年	3,750	12,118	3,759	▲0.002	▲0.001	43.8
3~5年	4,250	10,640	4,256	▲0.009	▲0.008	44.0
5~10年	4,750	10,229	4,755	▲0.023	▲0.018	27.0
国債補完供給(2/2~2/5)						
	33,535	33,535	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マナタリーベース	所要
2月1日時点	6,666,500

所要	所要
今積期の所要準備額	4,040,400
2月5日以降の残り所要	
積数	4,200
平均	400

国庫短期証券入札予定

2月8日	6ヶ月(第1211回)
2月9日	3ヶ月(第1212回)
2月16日	3ヶ月
2月19日	1年
2月5日	物価連動
2月7日	30年
2月9日	5年
2月14日	10年プライメート・トランジション

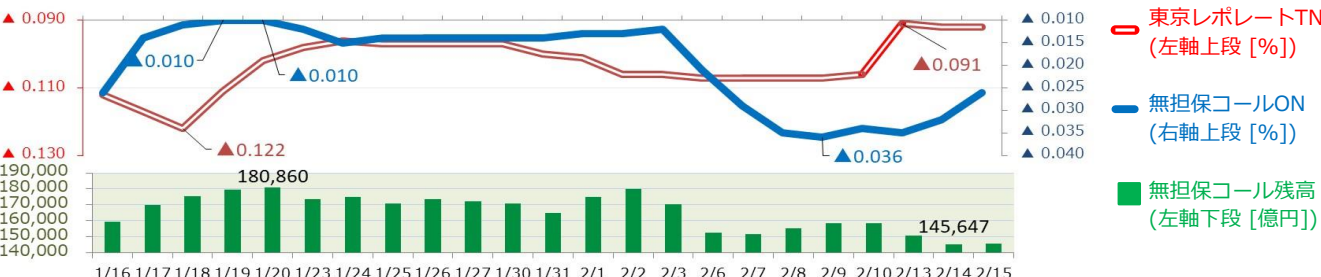
今月の国債買入オペ予定

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2日	0
1年超3年以下	3,000~6,500	3,750	2 8 15 21	2月2日	3
3年超5年以下	3,500~7,500	4,250	2 8 15 21	2月2日	3
5年超10年以下	4,000~9,000	4,750	2 8 21 28	2月2日	3
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