



### 短期市場の推移

	1月31日	2月1日	2月2日	2月5日
加重平均金利	▲0.011	▲0.010	▲0.008	▲0.008
東京レボレート(TN)	▲0.084	▲0.080	▲0.071	▲0.083
無コール残	149,610	156,433	155,371	157,008
ON	72,192	73,675	72,573	73,060
その他	77,418	82,758	82,798	83,948
有コール残	29,366	30,079	31,937	29,704

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	▲0.007	▲0.082
T/N	-	-	▲0.005	▲0.082
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.015	▲0.003	▲0.011	▲0.087
2W	▲0.012	0.000	▲0.009	▲0.091
3W	-	-	-	▲0.098
1M	-	-	0.100	▲0.103
2M	-	-	-	-
3M	-	-	0.020	▲0.123
6M	-	-	-	▲0.089
1Y	-	-	-	▲0.054

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7日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	(米) 貿易収支 (12月)	-
-	-	-	-
-	-	-	-

### 本日の市況

無担保コールON物は▲0.003%の合から始まり、その後は主に▲0.010%~▲0.002%を中心に取引された。引き続きビットサイドの調達意欲は旺盛であり、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比0.001%上昇の▲0.007%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.008 ~ ▲0.008	- ~ -	▲0.010 ~ ▲0.003

### 翌営業日のマーケット

引き続きビットサイドの資金調達ニーズは底堅く、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
	2月6日		2月7日		2月8日
券		+700		+500	+0
財政		▲6,300		+5,300	▲8,000
過不足		▲5,600		+5,800	▲8,000
金融調節	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド
国庫短期証券買入				+1,000	
国債買現先	▲49,900	+29,600			
共通担保(全店)			▲8,500	+7,500	
国債補充供給	+36,400	▲33,200	+33,200		
当座預金増減		▲22,700		+39,000	▲8,000
当座預金残高		5,340,800		5,379,800	5,371,800
準備預金残高		4,660,800			
積み終了先		4,660,200			
超過準備		4,660,200			
非準備先残高		680,000			
準備預金進捗率		99.9%			
平均		71.0%			
乖離率		28.9%			

### 2月6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(2/7~)	1,000	6,170	1,000	0.017	0.019	83.8
米ドル資金供給(2/8~2/15)	4	4	5,570	5,570		
国債補充供給(2/6~2/7)	33,359	33,359	▲0.350	▲0.350		
共通担保(全店)(2/7~2/21)	100	100	▲0.350	▲0.350		
米ドル資金供給用担保国債供給(2/7~2/16)	5,000	2	2	▲0.100	▲0.100	

マナタリーベース	【億円】
2月5日時点	6,625,300

所要	【億円】
今積期の所要準備額	4,040,400
2月7日以降の残り所要	
積数	2,700
平均	300

### 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

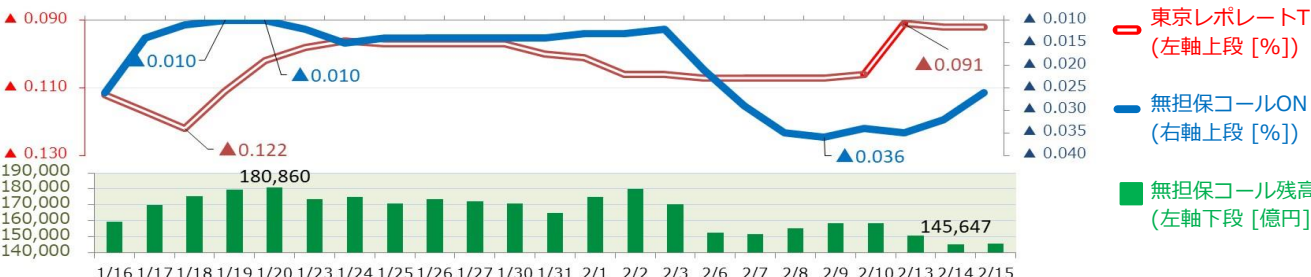
### 今月の国債買入オペ予定

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