



短期市場の推移 [億円] [%]

	2月2日	2月5日	2月6日	2月7日
加重平均金利	▲0.008	▲0.008	▲0.007	▲0.006
東京レポレート(TN)	▲0.071	▲0.083	▲0.082	▲0.090
無コール残	155,371	157,008	172,062	170,703
ON	72,573	73,060	84,094	83,885
その他	82,798	83,948	87,968	86,818
有コール残	31,937	29,704	28,944	29,738

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	▲0.087	0.001	▲0.005	▲0.076
T/N	-	-	▲0.001	▲0.074
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.040	▲0.007	▲0.027	▲0.081
2W	-	-	▲0.002	▲0.089
3W	-	-	-	▲0.095
1M	0.000	0.255	0.088	▲0.101
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.118
6M	-	-	-	▲0.087
1Y	-	-	-	▲0.050

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9日の予定 (時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
8:50	マネーストック (1月)		-	
			-	
			-	

本日の市況

無担保コールON物は▲0.002%の出合から始まり、その後は主に▲0.008%~▲0.001%を中心に取引された。引き続きビッド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▲0.005%となった。

都銀・信託	証券	地銀
- ~ -	- ~ -	▲0.008 ~ ▲0.001

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 [億円]

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	2月8日	2月9日	2月9日	2月13日	2月13日	2月13日
券	+500		+700		+1,000	
財政	▲11,800		+5,100		▲28,000	
過不足	▲11,300		+5,800		▲27,000	
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				+14,300		
CP等買入	▲100		▲100			
国債補完供給	+33,300	▲31,600	+31,600			
当座預金増減	▲9,700		+51,600		▲27,000	
当座預金残高	5,336,000		5,387,600		5,360,600	
準備預金残高	4,661,300					
積み終了先	4,660,800					
超過準備	4,660,800					
非準備先残高	674,700					
準備預金進捗率	99.9%					
平均	77.4%					
乖離率	22.5%					

2月8日のオペ結果 [%][億円] ※米ドル資金供給は百万\$

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
国債買入(2/9~)						
1~3年	3,750	6,909	3,755	0.000	0.002	41.8
3~5年	4,250	8,347	4,255	0.002	0.003	89.0
5~10年	4,750	10,680	4,758	▲0.005	▲0.004	77.2
10~25年	1,500	3,781	1,509	▲0.005	0.003	38.7
CP等買入(2/14~)						
	4,000	9,422	3,999	0.007	0.019	90.0
国債補完供給(2/8~2/9)						
	31,869	31,869	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マネタリーベース [億円]	所要 [億円]
2月7日時点 6,606,400	今積期の所要準備額 4,044,000
	2月9日以降の残り所要
	積数 1,400
	平均 200

国債短期証券入札予定

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22日	3ヶ月

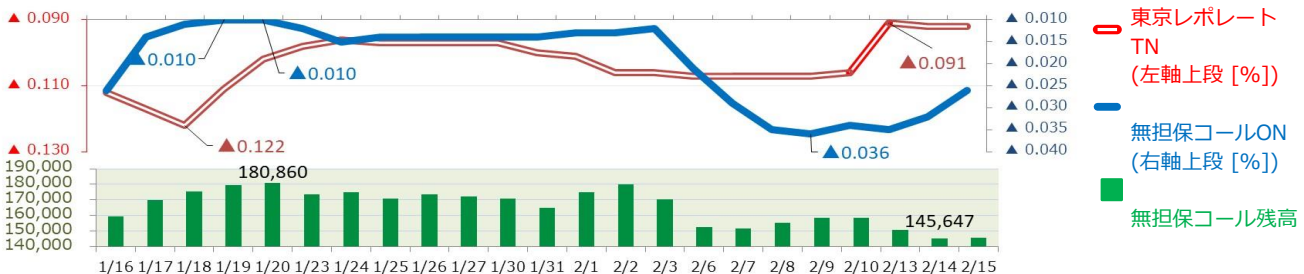
今月の国債買入オペ予定

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2日	0
1年超3年以下	3,000~6,500	3,750	2 8 15 21	2月8日	2
3年超5年以下	3,500~7,500	4,250	2 8 15 21	2月8日	2
5年超10年以下	4,000~9,000	4,750	2 8 21 28	2月8日	2
10年超25年以下	1,000~5,000	1,500	8 15 28	2月8日	2
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