



短期市場の推移

	1月30日	1月31日	2月3日	2月4日
加重平均金利	0.477	0.477	0.476	0.477
東京レボレート(TN)	0.147	0.404	0.431	0.448
無コール残	84,972	84,069	81,141	82,790
ON	35,816	36,710	34,152	36,861
その他	49,156	47,359	46,989	45,929
有コール残	41,476	40,212	39,728	39,420

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	0.450	0.525	0.479	0.460
T/N	-	-	-	0.449
S/N	-	-	-	-
1W	0.480	0.550	0.486	0.434
2W	-	-	0.550	0.435
3W	-	-	-	0.436
1M	-	-	0.550	0.434
2M	-	-	-	-
3M	0.600	0.650	0.618	0.447
6M	-	-	-	0.479
1Y	-	-	-	0.551

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6日の予定 (時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
10:30	田村日銀審議委員のあいさつ(長野県)		(欧) 小売売上高(12月)		
	-		-		
	-		-		

本日の市況

無担保コールON物は0.477%の出合から始まり、その後は主に同水準を中心に取引された。ビットサイドの資金調達意欲は引き続き底堅く、一部金融機関による試し取りが行われたことから、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.002%の0.479%となった。

都銀・信託		証券	地銀	
- ~ -		0.477 ~ 0.477	0.477 ~ 0.477	

翌営業日のマーケット

ビットサイドの資金調達意欲は引き続き旺盛であるため、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5日	2月6日	2月6日	2月7日	2月7日
券	+900	+900	+900	+1,000	+1,000
財政	▲27,700	+1,700	+1,700	▲7,000	▲7,000
過不足	▲26,800	+2,600	+2,600	▲6,000	▲6,000
金融調節	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド
共通担保(全店)	▲8,000	+8,000			
国債補充供給	+4,900	▲5,000	+5,000		
当座預金増減	▲26,900	+7,600	+7,600	▲6,000	▲6,000
当座預金残高	5,170,900	5,178,500	5,178,500	5,172,500	5,172,500
準備預金残高	4,669,900				
積み終了先	4,669,200				
超過準備	4,669,200				
非準備先残高	501,000				
準備預金進捗率	99.9%				
平均	67.7%				
乖離率	32.2%				

2月5日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
国債補充供給(2/5~2/6)	5,199	5,199	0.150	0.150		
	10	10	0.150	0.150		

マネタリーベース [億円]
2月4日時点 6,445,500

所要	[億円]
今積期の所要準備額	4,074,100
2月6日以降の残り所要	
積数	3,700
平均	400

国庫短期証券入札予定

2月6日	6ヶ月(第1285回)
2月7日	3ヶ月(第1286回)
2月14日	3ヶ月
2月19日	1年
2月6日	30年
2月12日	物価連動
2月14日	5年
2月18日	20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	3		2月3日 0
1年超3年以下	3000	3,000	3 7 13 19		2月3日 3
3年超5年以下	3000	3,000	3 7 19 26		2月3日 3
5年超10年以下	3250	3,250	7 13 19 26		1月30日 4
10年超25年以下	1500	1,500	3 13 26		2月3日 2
25年超	750	750	13 19		1月30日 2
物価連動債	500	500	26		1月30日 1
変動利付債	-	300	-		4月14日 -

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