



短期市場の推移

[億円][%]

	1月27日	1月28日	1月29日	1月30日
加重平均金利	0.736	0.727	0.727	0.727
東京レボ レート(TN)	0.750	0.746	0.741	0.750
無コール残	109,794	100,017	102,315	100,152
ON	48,876	38,919	40,097	38,634
その他	60,918	61,098	62,218	61,518
有コール残	27,314	28,161	25,779	25,365

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重。

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	0.700	0.728	0.727	0.748
T/N	-	-	0.850	0.750
S/N	-	-	-	-
1W	0.734	0.850	0.768	0.745
2W	0.728	0.850	0.747	0.745
3W	-	-	-	0.745
1M	-	-	0.800	0.747
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	0.762
6M	-	-	-	0.827
1Y	-	-	-	0.943

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

資金需給

[億円]

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	2月2日		2月3日		2月4日	
券	+900		+800		+0	
財政	▲25,300		▲22,700		▲100,000	
過不足	▲24,400		▲21,900		▲100,000	
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
共通担保(全店)	▲300		▲3,300		▲8,000	
社債等買入	+2,500		+3,300			
国債補完供給	▲3,300		+3,300			
当座預金増減	▲25,500		▲18,600		▲108,000	
当座預金残高	4,656,000		4,637,400		4,529,400	
準備預金残高	4,301,600		主な需給要因			
積み終了先	4,300,300		国債発行(10年)			
超過準備	4,300,300		法人税・消費税・			
非準備先残高	354,400		保険料揚げ			
準備預金進捗率	99.9%					
平均	58.1%					
乖離率	41.8%					

国庫短期証券入札予定

2月6日	3ヶ月(第1360回)
2月9日	6ヶ月(第1361回)
2月13日	3ヶ月
2月19日	1年
国債入札予定	
2月3日	10年
2月5日	30年
2月10日	物価連動
2月17日	5年

今月の国債買入オペ予定

オペ種類	一回当たりオペ金額	直近オペ金額	オペ予定日	直近日	残り回数
1年以下	1000	1,000	4	1月7日	1
1年超3年以下	2700	2,700	4 12 18	1月21日	3
3年超5年以下	2450	2,450	4 12 26	1月29日	3
5年超10年以下	2600	2,600	12 18 26	1月29日	3
10年超25年以下	950	950	4 12 26	1月29日	3
25年超	750	750	12 18	1月21日	2
物価連動債	400	400	26	1月29日	1
変動利付債	-	300	-	4月14日	-

2月3日の予定(時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
8:50	マネタリーベース(1月)			-	
	-			-	
	-			-	

本日の市況

無担保コールON物は0.727%の出合から始まり、その後も同程度で推移した。ON物加重平均金利(速報)は前営業対比横ばいの0.727%となった。

都銀・信託	証券	地銀
- ~ -	0.727 ~ 0.727	0.727 ~ 0.727

翌営業日のマーケット

出合いの水準は本日対比横ばい圏を予想する。

[%][億円]※米ドル資金供給は百万\$

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
国債補完供給(2/2~2/3)	3,563	3,563	0.550	0.550		
	0	0				

マネタリーベース [億円]

1月30日時点 5,901,400

所要

今積期の所要準備額	4,133,500
2月3日以降の残り所要	
積数	1,500
平均	100

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