



短期市場の推移

[億円][%]

	1月28日	1月29日	1月30日	2月2日
加重平均金利	0.727	0.727	0.727	0.727
東京レボ レート(TN)	0.746	0.741	0.750	0.750
無コール残	100,017	102,315	100,152	108,652
ON	38,919	40,097	38,634	45,804
その他	61,098	62,218	61,518	62,848
有コール残	28,161	25,779	25,365	25,467

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	0.780	0.730	0.742
T/N	-	-	-	0.747
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	0.780	0.746
2W	0.710	0.800	0.727	0.746
3W	-	-	-	0.746
1M	0.780	0.850	0.786	0.747
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	0.766
6M	-	-	-	0.828
1Y	-	-	-	0.945

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3日	2月4日	2月5日
券	+800	+600	+0
財政	▲18,900	▲91,400	+7,000
過不足	▲18,100	▲90,800	+7,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
共通担保(全店)		▲8,000	+8,000
国債補完供給	+2,700	+2,900	
社債等買入		▲200	
当座預金増減	▲18,300	▲88,100	+7,000
当座預金残高	4,637,700	4,549,600	4,556,600
準備預金残高	4,272,300		
積み終了先	4,271,300	国債発行(10年)	
超過準備	4,271,300	法人税・消費税・保険 料揚げ	
非準備先残高	365,400		
準備預金進捗率	99.9%		
平均	61.3%		
乖離率	38.6%		

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5日	30年
2月10日	物価連動
2月17日	5年
2月19日	20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	-

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

2月4日の予定(時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
8:50	日銀当座預金増減要因 (2月見込み)		(米) ADP雇用統計 (1月)		
	-		(米) サービス業PMI (1月)		
	-		(欧) ユーロ圏CPI (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。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)は前営業対比+0.003%の0.730%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3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(2/3~2/4)

3,203	3,203	0.550	0.550
0	0		

共通担保(全店)(2/4~2/18)

8,000	16,084	8,007	49.8
-------	--------	-------	------

米ドル資金供給用担保国債供給(2/4~2/16)

5,000	2	2	0.720	0.720
-------	---	---	-------	-------

米ドル資金供給(2/5~2/13)

3	3	3.890	3.890
---	---	-------	-------

マネタリーベース [億円]

2月2日時点 5,875,000

所要

[億円]

今積期の所要準備額	4,133,500
2月4日以降の残り所要	
積数	500
平均	0