



短期市場の推移

[億円] [%]

	1月30日	2月2日	2月3日	2月4日
加重平均金利	0.727	0.727	0.730	0.727
東京レボレート(TN)	0.750	0.750	0.747	0.746
無コール残	100,152	108,652	109,260	97,353
ON	38,634	45,804	45,692	34,135
その他	61,518	62,848	63,568	63,218
有コール残	25,365	25,467	24,608	24,452

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意。

本日の短期市場金利

[%]

	無担保コール(速報)			レボ市場 東京レボレート
	最低	最高	平均	
O/N	0.700	0.780	0.727	0.744
T/N	-	-	-	0.749
S/N	-	-	-	-
1W	0.780	0.785	0.782	0.746
2W	0.720	0.731	0.727	0.746
3W	-	-	-	0.746
1M	0.840	0.920	0.870	0.748
2M	-	-	-	-
3M	0.910	0.950	0.934	0.771
6M	-	-	-	0.834
1Y	-	-	-	0.953

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	増日銀審議委員のあいさつ(愛媛県)			-	
14:00	景気動向指数速報(12月)			-	
15:00	コール市場残高(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\$

資金需給

[億円]

	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9日	2月9日
券		+0		+600		+1,000
財政		+4,800		▲14,600		▲4,000
過不足		+4,800		▲14,000		▲3,000
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		+6,900				
国債補充供給	+2,300	▲2,500	+2,500			
当座預金増減		+11,500		▲11,500		▲3,000
当座預金残高		4,556,500		4,545,000		4,542,000
準備預金残高		4,195,000		主な需給要因		
積み終了先		4,194,900		国債発行(30年)		国庫短期証券発行償還(3M)
超過準備		4,194,900				
非準備先残高		361,500				
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)

2,700	2,700	0.450	0.447
0	0		

マネタリーベース [億円]
2月4日時点 5,762,600

所要	[億円]
今積期の所要準備額	4,133,500
2月6日以降の残り所要	
積数	200
平均	0

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10日	物価連動
2月17日	5年
2月19日	20年
2月27日	2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	1000	1,000	4	12	18		2月4日	0
1年超3年以下	2700	2,700	4	12	18		2月4日	2
3年超5年以下	2450	2,450	4	12	26		2月4日	2
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		2月4日	2
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