



短期市場の推移

	2月5日	2月8日	2月9日	2月10日
加重平均金利	▲0.010	▲0.011	▲0.010	▲0.008
東京レポレート(TN)	▲0.081	▲0.086	▲0.085	▲0.087
無コール残	126,498	105,861	102,598	97,291
ON	68,335	51,478	56,365	51,858
その他	58,163	54,383	46,233	45,433
有コール残	21,047	20,663	21,222	20,905

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	▲0.070	0.001	▲0.011	▲0.081
T/N	▲0.005	▲0.001	▲0.002	▲0.083
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.015	▲0.005	▲0.008	▲0.087
2W	▲0.008	0.001	▲0.004	▲0.087
3W	-	-	-	▲0.091
1M	▲0.015	0.040	▲0.009	▲0.095
2M	-	-	0.020	-
3M	-	-	0.005	▲0.100
6M	-	-	-	▲0.112
1Y	-	-	-	▲0.138

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15日の予定 (時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
8:50	10-12月期国内総生産(GDP)速報値[前期比年率]	+10.1%	-	(米)休場(プレジデント・デー)	-
10:00	営業毎旬報告(2月10日現在)	-	19:00	(欧)12月鉱工業生産指数[前月比]	-0.5%
13:00	鉱工業生産確報(12月)	-	-	(欧)ユーロ圏財務相会合(ブリュッセル)	-

経済指標及び予想値は株式会社フィスコ提供

本日の市況

本日の無担保コールON物は▲0.005%の出合から始まり、その後は主に▲0.015%~▲0.003%の水準で出合が見られた。同加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.003%の▲0.011%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.015 ~ ▲0.010	▲0.007 ~ ▲0.005	▲0.005 ~ ▲0.003

翌営業日のマーケット

積み期最終日となるが、調達意欲の強さは変わらず出合いの水準は横ばいを予想する。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	2月12日	2月15日	2月15日	2月16日	2月16日	2月16日
券	+300	+100	+100	▲1,000		
財政	▲6,300	+59,000	+59,000	+2,000		
過不足	▲6,000	+59,100	+59,100	+1,000		
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
国庫短期証券買入		+15,000				
共通担保(全店)	▲4,000	+3,600				
CP等買入	▲100		▲900	+6,000		
E T F 買入		+500				
国債補充供給	+800	▲1,100	+1,100			
当座預金増減	+8,700	+65,300	+65,300	+1,000		
当座預金残高	4,869,900	4,935,200	4,935,200	4,936,200		
準備預金残高	4,296,900	主な需給要因				
積み終了先	4,296,900					
超過準備	4,296,900					
非準備先残高	573,000					
準備預金進捗率	100.0%					
平均	96.8%					
乖離率	3.2%					

2月12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(2/12~2/15)	1,113	1,113	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マネタリーベース (億円)
2月10日時点 6,064,600

所要	(億円)
今積期の所要準備額	3,617,200
2月15日以降の残り所要	
積数	0
平均	0

国庫短期証券入札予定

2月18日	1年	第973回
2月19日	3ヶ月	第974回
2月24日	6ヶ月	
2月26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	500~1,500	1,000	月2回程度	2月5日	1
1年超3年以下	2,500~5,500	4,000	3 9 15 19 25	2月9日	3
3年超5年以下	2,000~5,500	3,700	3 9 15 19 25	2月9日	3
5年超10年以下	2,500~6,000	4,200	5 9 15 19 25	2月9日	3
10年超25年以下	500~2,000	1,200	5 22	2月5日	1
25年超	0~500	300	9 22	2月9日	1
物価連動債	300	300	月2回程度	1月27日	2
変動利付債<偶数日>	500	500	月1回	12月7日	1

1年前の市場推移

○2020年1月積み期 [1月16日~2月14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