



短期市場の推移

[億円] [%]

	2月7日	2月8日	2月9日	2月10日
加重平均金利	▲0.029	▲0.035	▲0.036	▲0.034
東京レボ レート(TN)	▲0.107	▲0.107	▲0.107	▲0.106
無コール残	151,888	155,626	158,568	158,627
ON	85,976	88,479	90,671	91,590
その他	65,912	67,147	67,897	67,037
有コール残	26,755	26,986	26,521	26,768

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
	最低	最高	平均	東京レボ レート
O/N	▲0.073	0.001	▲0.035	▲0.091
T/N	-	-	▲0.010	▲0.091
S/N	-	-	▲0.010	-
1W	-	-	-	▲0.107
2W	-	-	-	▲0.117
3W	-	-	▲0.015	▲0.128
1M	-	-	-	▲0.143
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.147
6M	-	-	-	▲0.107
1Y	-	-	-	▲0.082

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13日	2月14日	2月14日	2月15日	2月15日	2月16日
券		+900		+400		+0
財政		+5,800		+1,500		+76,000
過不足		+6,700		+1,900		+76,000
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		+200				
CP等買入	▲100	+4,000	▲300			
国債補完供給	+54,500	▲52,700	+52,700			
当座預金増減		+12,600		+54,300		+76,000
当座預金残高		5,164,900		5,219,200		5,295,200
準備預金残高		4,546,000				
積み終了先		4,546,000				
超過準備		4,546,000				
非準備先残高		618,900				
準備預金進捗率		100.0%				
平均		93.5%				
乖離率		6.5%				

2月13日のオペ結果

[%][億円]※米ドル資金供給は百万\$

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
------	------	----	----	----	----	----

国債買入(固定利回り方式)(2/14~)

5~10年 0 0

5~10年 0 0

国債補完供給(2/13~2/14)

52,917 52,917 ▲0.350 ▲0.351

224 224 ▲0.350 ▲0.350

マネタリーベース [億円]

2月10日時点 6,418,900

所要

今積期の所要準備額 3,906,000

2月14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16日	1年 (第1139回)
2月17日	3ヶ月(第1140回)
2月24日	3ヶ月
3月3日	3ヶ月

国債入札予定

2月16日	5年
2月21日	20年
2月28日	2年
3月2日	10年

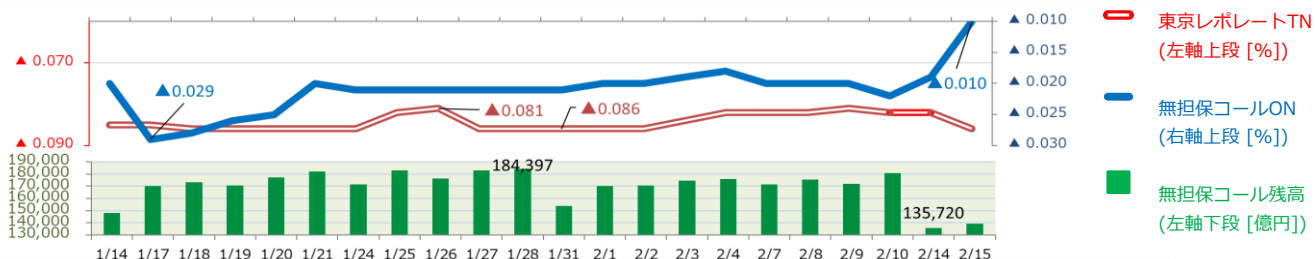
今月の国債買入オペ予定

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	月1回	2月3日	0
1年超3年以下	4,250~5,750	4,250	3 8 15 20	2月8日	2
3年超5年以下	5,000~6,500	5,000	3 8 20 27	2月8日	2
5年超10年以下	5,750~7,750	6,750	8 15 20 27	2月8日	3
10年超25年以下	2,000~4,000	3,000	3 8 15 27	2月8日	2
25年超	1,000~3,000	2,000	3 15 20	2月3日	2
物価連動債	600	600	月1回	1月30日	1
変動利付債<四半期>	300	300	四半期に1回	1月12日	-

1年前の市場推移

○2022年1月積み期 [1月14日~2月15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