



短期市場の推移

	2月8日	2月9日	2月10日	2月13日
加重平均金利	▲0.035	▲0.036	▲0.034	▲0.035
東京レポレート(TN)	▲0.107	▲0.107	▲0.106	▲0.091
無コール残	155,626	158,568	158,627	150,813
ON	88,479	90,671	91,590	84,126
その他	67,147	67,897	67,037	66,687
有コール残	26,986	26,521	26,768	28,930

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	▲0.032	▲0.091
T/N	-	-	▲0.010	▲0.092
S/N	-	-	▲0.010	-
1W	-	-	-	▲0.110
2W	▲0.030	▲0.002	▲0.024	▲0.117
3W	-	-	-	▲0.128
1M	▲0.013	0.100	0.025	▲0.139
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.146
6M	-	-	-	▲0.105
1Y	-	-	-	▲0.081

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
-	-	22:30 (米)1月小売売上高	1.7%
-	-	23:15 (米)1月鉱工業生産指数[前月比]	0.5%
-	-	-	-

本日の市況

本日の無担保コールON物は▲0.032%の合出から始まり、その後は主に▲0.038%~▲0.030%の水準で取引された。積み終盤の調整もあり、ビッドサイドの調達意欲は相応に見られ、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.003%の▲0.032%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.045 ~ ▲0.030	- ~ -	▲0.043 ~ ▲0.023

翌営業日のマーケット

積み最終日の調整での調達意欲は一定量見られるため、レートは上昇を想定。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	2月14日	2月15日	2月14日	2月15日	2月14日	2月15日
券		+400		▲400		+0
財政		+800		+72,400		+5,000
過不足		+1,200		+72,000		+5,000
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				+1,000		
共通担保(全店)				+10,000		
CP等買入	▲300		▲500			
国債補充供給	+52,700	▲53,300	+53,300			
当座預金増減		+300		+135,800		+5,000
当座預金残高		5,165,200		5,301,000		5,306,000
準備預金残高		4,548,900		4,548,900		4,548,900
積み終了先		4,548,900		4,548,900		4,548,900
超過準備		4,548,900		4,548,900		4,548,900
非準備先残高		616,300		616,300		616,300
準備預金進捗率		100.0%		100.0%		100.0%
平均		96.8%		96.8%		96.8%
乖離率		3.2%		3.2%		3.2%

2月14日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
国庫短期証券買入(2/15~)	1,000	3,365	1,000	0.006	0.006	
国債買入(固定利回り方式)(2/15~)						
5~10年		0	0			
5~10年		0	0			
米ドル資金供給(2/16~2/24)						
		1	1	4.830	4.830	
国債補充供給(2/14~2/15)						
		53,837	53,837	▲0.350	▲0.351	
		0	0			
共通担保(金利入札方式)(2023/2/15~2028/2/15)						
		30,318	10,004	0.121	0.100	19.0

マナタリーベース	所要
2月13日時点	6,430,700
今積期の所要準備額	3,906,000
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

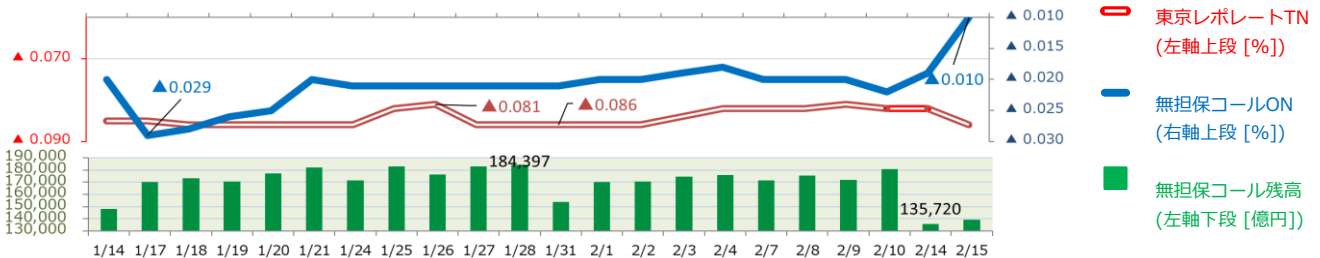
今月の国債買入オペ予定

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