



短期市場の推移

	2月6日	2月7日	2月10日	2月12日
加重平均金利	0.479	0.477	0.477	0.485
東京レボレート(TN)	0.410	0.445	0.457	0.449
無コール残	86,088	83,028	82,955	88,072
ON	38,099	35,649	36,006	42,803
その他	47,989	47,379	46,949	45,269
有コール残	38,637	38,702	39,842	38,447

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	0.450	0.525	0.477	0.384
T/N	-	-	-	0.351
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	-	0.411
2W	-	-	0.550	0.419
3W	-	-	-	0.422
1M	-	-	0.540	0.427
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	0.449
6M	-	-	-	0.482
1Y	-	-	-	0.552

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14日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	(欧) 10~12月GDP	-
-	-	(米) 1月の小売売上高	-
-	-	(米) 1月の鉱工業生産	-

本日の市況

無担保コールON物は0.477%の出合から始まり、その後は同水準を中心に取引された。ビットサイドの資金調達意欲は引き続き底堅く、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.008%の0.477%となった。

都銀・信託	証券	地銀
- ~ -	0.477 ~ 0.477	0.477 ~ 0.477

翌営業日のマーケット

ビットサイドの資金調達意欲は引き続き旺盛であるため、出合の水準は本日対比横ばい圏を予想する。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想
	2月13日	2月14日	2月14日	2月17日	2月17日
券	+600	+500	+500	+1,000	+1,000
財政	+12,500	+82,000	+82,000	▲24,000	▲24,000
過不足	+13,100	+82,500	+82,500	▲23,000	▲23,000
金融調節	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド
国債買入			+7,800		
CP等買入			▲100		
被災地金融機関支援				▲300	
国債補充供給	+4,800	▲2,900	+2,900		
当座預金増減	+15,000	+93,100	+93,100	▲23,300	▲23,300
当座預金残高	5,208,900	5,302,000	5,302,000	5,278,700	5,278,700
準備預金残高	4,702,400	主な需給要因			
積み終了先	4,702,100	年金定時払い	国庫短期証券発行償還		
超過準備	4,702,100		(3M)		
非準備先残高	506,500		国債発行		
準備預金進捗率	99.9%		(5年・個人)		
平均	93.5%		国債償還(個人)		
乖離率	6.4%				

2月13日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
国債買入(2/14~)						
1~3年	3,000	10,112	3,001	0.003	0.004	79.9
5~10年	3,250	4,788	3,255	0.020	0.024	4.5
10~25年	1,500	3,389	1,503	0.027	0.030	98.9
25年~	750	2,110	750	0.018	0.024	20.0
国債補充供給(2/13~2/14)						
	3,096	3,096	0.150	0.150		
	0	0				

マネタリーベース (億円)
 2月12日時点 6,437,400

所要	所要
今積期の所要準備額	4,082,300
2月14日以降の残り所要	
積数	700
平均	300

国庫短期証券入札予定

2月14日	3ヶ月(第1287回)
2月19日	1年(第1288回)
2月21日	3ヶ月
2月28日	3ヶ月
国債入札予定	
2月14日	5年
2月18日	20年
2月27日	2年
3月4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	3	2月3日	0
1年超3年以下	3000	3,000	3 7 13 19	2月13日	1
3年超5年以下	3000	3,000	3 7 19 26	2月7日	2
5年超10年以下	3250	3,250	7 13 19 26	2月13日	2
10年超25年以下	1500	1,500	3 13 26	2月13日	1
25年超	750	750	13 19	2月13日	1
物価連動債	500	500	26	1月30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