



## 短期市場の推移

[億円] [%]

|             | 2月4日   | 2月5日    | 2月6日    | 2月9日   |
|-------------|--------|---------|---------|--------|
| 加重平均金利      | 0.727  | 0.727   | 0.728   | 0.728  |
| 東京レボレート(TN) | 0.746  | 0.749   | 0.750   | 0.750  |
| 無コール残       | 97,353 | 102,159 | 100,388 | 99,712 |
| ON          | 34,135 | 38,831  | 36,880  | 35,399 |
| その他         | 63,218 | 63,328  | 63,508  | 64,313 |
| 有コール残       | 24,452 | 24,779  | 25,333  | 25,738 |

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 | 0.700      | 0.780 | 0.727 | 0.748   |
| T/N | -          | -     | -     | 0.750   |
| S/N | -          | -     | -     | -       |
| 1W  | -          | -     | 0.732 | 0.747   |
| 2W  | 0.710      | 0.800 | 0.721 | 0.747   |
| 3W  | -          | -     | -     | 0.747   |
| 1M  | -          | -     | 0.930 | 0.748   |
| 2M  | -          | -     | -     | -       |
| 3M  | -          | -     | -     | 0.792   |
| 6M  | -          | -     | -     | 0.855   |
| 1Y  | -          | -     | -     | 0.969   |

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10日     | 2月12日  | 2月12日     | 2月13日 | 2月13日     | 2月13日 |
| 券       | +0        |        | +300      |       | ▲2,000    |       |
| 財政      | ▲600      |        | ▲2,000    |       | +79,000   |       |
| 過不足     | ▲600      |        | ▲1,700    |       | +77,000   |       |
| 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  |
| 国債補完供給  | +3,700    | ▲3,700 | +3,700    |       |           |       |
| 当座預金増減  | ▲600      |        | +2,000    |       | +77,000   |       |
| 当座預金残高  | 4,540,800 |        | 4,542,800 |       | 4,619,800 |       |
| 準備預金残高  | 4,193,100 |        | 4,193,100 |       | 4,193,100 |       |
| 積み終了先   | 4,193,100 |        | 4,193,100 |       | 4,193,100 |       |
| 超過準備    | 4,193,100 |        | 4,193,100 |       | 4,193,100 |       |
| 非準備先残高  | 347,700   |        | 347,700   |       | 347,700   |       |
| 準備預金進捗率 | 100.0%    |        | 100.0%    |       | 100.0%    |       |
| 平均      | 87.1%     |        | 87.1%     |       | 87.1%     |       |
| 乖離率     | 12.9%     |        | 12.9%     |       | 12.9%     |       |

## 2月10日のオペ結果

オペ種類 オファー 応札 落札 足切 平均 按分

## 国債補完供給(2/10~2/12)

4,022 4,022 0.550 0.550  
30 30 0.550 0.550

## 米ドル資金供給用担保国債供給(2/12~2/20)

5,000 4 4 0.720 0.720

## 米ドル資金供給(2/13~2/19)

4 4 3.890 3.890

## マネタリーベース [億円]

2月9日時点 5,757,800

## 所要

[億円]

今積期の所要準備額 4,138,900

2月12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13日 | 3ヶ月(第1362回) |
|-------|-------------|
| 2月19日 | 1年          |
| 2月20日 | 3ヶ月         |
| 2月27日 | 3ヶ月         |

## 国債入札予定

|       |     |
|-------|-----|
| 2月17日 | 5年  |
| 2月19日 | 20年 |
| 2月27日 | 2年  |
| 3月3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      | 1000        | 1,000   | 4        | 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