



短期市場の推移

[億円] [%]

	2月5日	2月6日	2月9日	2月10日
加重平均金利	0.727	0.728	0.728	0.727
東京レボ レート(TN)	0.749	0.750	0.750	0.750
無コール残	102,159	100,388	99,712	98,397
ON	38,831	36,880	35,399	34,334
その他	63,328	63,508	64,313	64,063
有コール残	24,779	25,333	25,738	26,048

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	0.728	0.742
T/N	-	-	-	0.749
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	-	0.747
2W	0.731	0.900	0.773	0.747
3W	-	-	-	0.747
1M	-	-	0.785	0.748
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	0.794
6M	-	-	-	0.861
1Y	-	-	-	0.970

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12日	2月13日	2月12日	2月13日	2月16日	2月17日
券		+300		+600		+2,000
財政		▲2,900		+80,200		▲15,000
過不足		▲2,600		+80,800		▲13,000
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				+9,100		
国債補充供給	+3,700	▲2,500	+2,500			
当座預金増減		▲1,400		+92,400		▲13,000
当座預金残高		4,539,400		4,631,800		4,618,800
準備預金残高		4,184,500				
積み終了先		4,184,500				
超過準備		4,184,500				
非準備先残高		354,900				
準備預金進捗率		100.0%				
平均		90.3%				
乖離率		9.7%				

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

国債買入(2/13~)

1~3年	2,700	7,365	2,702	▲0.009	▲0.007	5.9
3~5年	2,450	3,921	2,453	▲0.032	▲0.028	39.2
5~10年	2,600	6,047	2,603	▲0.048	▲0.046	63.7
10~25年	950	2,644	953	▲0.069	▲0.064	50.2
25年~	750	1,833	751	▲0.105	▲0.090	34.6

国債補充供給(2/12~2/13)

2,746	2,746	0.550	0.550
0	0		

マネタリーベース [億円]

2月10日時点 5,757,300

所要

今積期の所要準備額 4,138,900

2月13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(第1363回)
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	12	18			2月4日	0
1年超3年以下	2700	2,700	4	12	18			2月12日	1
3年超5年以下	2450	2,450	4	12	26			2月12日	1
5年超10年以下	2600	2,600	12	18	26			2月12日	2
10年超25年以下	950	950	4	12	26			2月12日	1
25年超	750	750	12	18				2月12日	1
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