



短期市場の推移

	2月10日	2月12日	2月13日	2月16日
加重平均金利	0.727	0.728	0.728	0.728
東京レボレート(TN)	0.750	0.749	0.750	0.750
無コール残	98,397	97,668	100,234	105,762
ON	34,334	33,805	37,521	43,454
その他	64,063	63,863	62,713	62,308
有コール残	26,048	26,351	26,838	26,913

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重

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	0.775	0.730	0.737
T/N	-	-	-	0.746
S/N	-	-	-	-
1W	0.730	0.790	0.750	0.746
2W	0.728	0.800	0.730	0.746
3W	-	-	-	0.746
1M	-	-	0.850	0.748
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	0.794
6M	-	-	-	0.868
1Y	-	-	-	0.982

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17日	2月18日	2月17日	2月18日	2月17日	2月18日
券	+700	▲600			+0	
財政	+3,800	▲34,600			+14,000	
過不足	+4,500	▲35,200			+14,000	
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
共通担保(全店)		▲8,000		+8,000		
国債補完供給	+4,000	▲2,100	+2,100			
社債等買入	▲100					
当座預金増減	+6,300	▲33,100			+14,000	
当座預金残高	4,622,500	4,589,400			4,603,400	
準備預金残高	4,265,600					
積み終了先	4,106,300					
超過準備	3,753,900					
非準備先残高	356,900					
準備預金進捗率	96.3%					
平均	7.1%					
乖離率	89.2%					

国庫短期証券入札予定

2月19日	1年(第1363回)
2月20日	3ヶ月(第1364回)
2月27日	3ヶ月
3月6日	3ヶ月

国債入札予定

2月19日	20年
2月27日	2年
3月3日	10年
3月5日	30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	-

2月18日の予定(時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
8:50	貿易収支(1月)		(米)FOMC議事要旨(1月27-28日)	
	-		(米)鉱工業生産(1月)	
	-		-	

本日の市況

無担保コールON物は0.727%の出合から始まり、その後も同程度で推移した。一部金融機関による試し取りが行われたことから、ON物加重平均金利(速報)は前営業対比+0.002%の0.730%となった。

都銀・信託	証券	地銀
- ~ -	0.727 ~ 0.727	0.727 ~ 0.727

翌営業日のマーケット

出合いの水準は本日対比横ばい圏を予想する。

[%][億円]※米ドル資金供給は百万\$

2月17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(2/17~2/18)	2,293	2,293	0.550	0.550		
	0	0				

共通担保(全店)(2/18~3/4)	8,000	16,396	8,005	48.8		
--------------------	-------	--------	-------	------	--	--

米ドル資金供給(2/19~2/26)	4	4	3.890	3.890		
--------------------	---	---	-------	-------	--	--

マネタリーベース [億円]

2月16日時点 5,831,100

所要

[億円]

今積期の所要準備額	3,731,900
2月18日以降の残り所要	
積数	137,300
平均	5,300

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