



短期市場の推移

	2月5日	2月6日	2月7日	2月10日
加重平均金利	0.479	0.479	0.477	0.477
東京レボレート(TN)	0.449	0.410	0.445	0.457
無コール残	84,229	86,088	83,028	82,955
ON	36,810	38,099	35,649	36,006
その他	47,419	47,989	47,379	46,949
有コール残	39,571	38,637	38,702	39,842

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	0.485	0.407
T/N	-	-	-	0.449
S/N	-	-	-	-
1W	0.478	0.550	0.483	0.439
2W	-	-	-	0.436
3W	-	-	-	0.434
1M	-	-	-	0.434
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	0.450
6M	-	-	-	0.480
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13日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	(欧) 鉱工業生産 (12月)	-
-	-	-	-
-	-	-	-

本日の市況

無担保コールON物は0.477%の出合から始まり、その後は主に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、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)は前営業日対比+0.008%の0.485%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

引き続きビットサイドの資金調達ニーズは旺盛であるが、試し取り要因剥落のため出合の水準は本日対比低下を予想する。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	2月12日	2月13日	2月13日	2月14日	2月14日	2月14日
券		+600		+300		+0
財政		▲600		+13,400		+78,000
過不足		+0		+13,700		+78,000
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	+4,100	▲4,800	+4,800			
当座預金増減		▲700		+18,500		+78,000
当座預金残高		5,193,900		5,212,400		5,290,400
準備預金残高		4,688,500	主な需給要因			
積み終了先		4,688,200	国債発行(10年・物)		年金定時払い	
超過準備		4,688,100	連)			
非準備先残高		505,400	源泉税揚げ			
準備預金進捗率		99.9%				
平均		90.3%				
乖離率		9.6%				

2月12日のオペ結果

[%][億円] ※米ドル資金供給は百万\$

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
米ドル資金供給(2/14~2/20)						
	5	5	4,580	4,580		
国債補完供給(2/12~2/13)						
	4,950	4,950	0.250	0.250		
	37	37	0.250	0.250		
米ドル資金供給用担保国債供給(2/13~2/21)						
	5,000	2	2	0.470	0.470	

マネタリーベース [億円]
 2月10日時点 6,438,700

所要	所要
今積期の所要準備額	4,082,300
2月13日以降の残り所要	
積数	1,000
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7日 2
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7日 3
10年超25年以下	1500	1,500	3 13 26		2月3日 2
25年超	750	750	13 19		1月30日 2
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