

### 短期市場の推移

	2月7日	2月8日	2月12日	2月13日
加重平均金利	▲0.049	▲0.047	▲0.049	▲0.051
東京レポレート(ON)	▲0.082	▲0.085	▲0.088	▲0.087
無コール残	86,758	95,838	78,572	86,108
ON	55,503	58,183	48,747	56,773
その他	31,255	37,655	29,825	29,335
有コール残	24,503	27,245	26,993	30,538

加重平均金利・コール残高は日銀、東京レポレートは日本証券協会公表  
※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。

### 2月15日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
13:30	12月の鉱工業生産確報	22:30	(米)2月ニューヨーク連銀製造業景気指数 7.5
-	-	23:15	(米)1月鉱工業生産指数[前月比] 0.1%
-	-	-	アトランタ連銀総裁の講演

経済指標及び予想値は株式会社フィスコ提供

### 本日の短期市場金利

	無担保コール(速報)			レポ市場
	最低	最高	平均	東京レポレート
O/N	▲0.086	0.001	▲0.052	▲0.082
T/N	-	-	▲0.020	▲0.119
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.030	▲0.010	▲0.023	▲0.132
2W	▲0.030	▲0.010	▲0.024	▲0.137
3W	-	-	-	▲0.139
1M	-	-	▲0.041	▲0.146
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.163
6M	-	-	-	▲0.164
1Y	-	-	-	▲0.164

無担保コール(速報)は日銀、東京レポレートは日本証券協会公表

### 本日の市況

本日の無担保コールON物は▲0.070%の出合から始まり、その後は主に▲0.080~▲0.015%の水準で出合が見られた。今積み期における調達余力が限定的であったことで同加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.001%の▲0.052%と3営業日連続で低下した。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.080 ~ ▲0.055	▲0.070 ~ ▲0.065	▲0.080 ~ ▲0.015

### 翌営業日のマーケット

来積み期にもかかる取引となることから、調達サイドの一部は慎重な動きとなることが予想される。

### 資金需給

	日銀速報 2月14日	日銀予想 2月15日	当社需給予想 2月18日
券	▲700	+0	+0
財政	▲30,800	+84,200	▲5,000
過不足	▲31,500	+84,200	▲5,000
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
国庫短期証券買入	+5,000		
国債買入		+5,900	
共通担保(全店)			▲700
CP等買入	▲200	▲500	
社債等買入	▲100		+2,000
ETF買入			
国債補充供給	+300 ▲100	+100	+500
当座預金増減	▲26,600	+90,200	▲3,700
当座預金残高	3,756,400	3,846,600	3,842,900
準備預金残高	3,326,300	主な需給要因	
積み終了先	3,326,200	10年物価連動国債発行	
超過準備	3,326,100	国庫短期証券発行・償還(3M)	
非準備預金残高	430,100	年金定時払い国債償還(2年)	
準備預金進捗率	99.9%		
平均	96.8%		
乖離率	3.1%		

### 2月14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	接分
国債買入(2/15~)						
~1年	500	1,264	500	0.005	0.005	
5~10年	4,300	13,339	4,305	▲0.009	▲0.008	53.2
変動利付	1,000	1,525	1,001	▲0.050	▲0.158	15.5
国債補充供給(2/14~2/15)						
	56,328	120	120	▲0.600	▲0.600	

マナタリーベース [億円]  
2月13日時点 4,895,600

所要 [億円]  
今積み期の所要準備額 3,135,900  
2月15日以降の残り所要積数 100  
平均 100

### 国庫短期証券入札予定

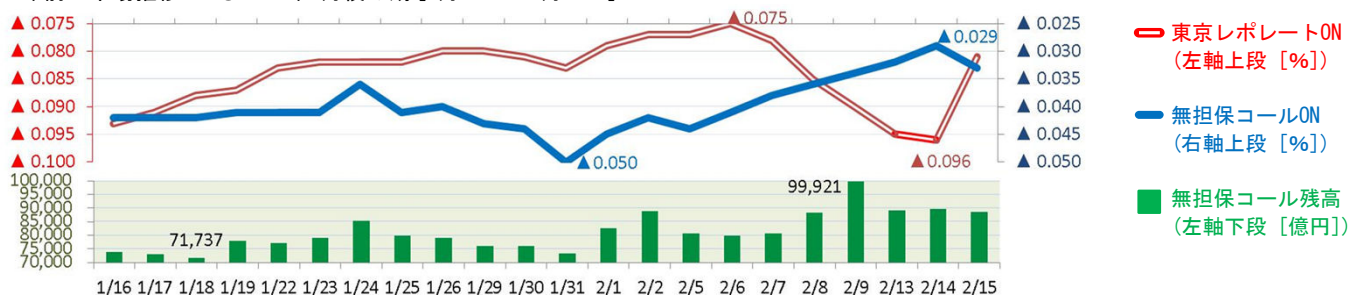
2月15日	3ヶ月	第814回
2月19日	1年	第815回
2月22日	3ヶ月	
3月1日	3ヶ月	

### 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	100~1,000 程度	500	月2回程度	2月14日	0
1年超3年以下	2,500~4,500 程度	3,500			
3年超5年以下	3,000~5,500 程度	4,000	4 6 18 27	2月8日	2
5年超10年以下	3,000~6,000 程度	4,300	6 8 14 22 27	2月14日	2
10年超25年以下	1,500~2,500 程度	1,800			
25年超	100~1,000 程度	500	4 12 18 22	2月12日	2
物価連動債	250 程度	250	月2回程度	2月6日	1
変動利付債<偶数月>	1,000 程度	1,000	1回	2月14日	0

### 1年前の市場推移 ○2018年1月積み期 [1月16日~2月15日]

※積み初日及び積み最終日が祝日・休日の場合は、前営業日のレート・残高を記載しています。



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。