

### 短期市場の推移

[億円] [%]

	2月8日	2月12日	2月13日	2月14日
加重平均金利	▲0.047	▲0.049	▲0.051	▲0.052
東京レポレート(ON)	▲0.085	▲0.088	▲0.087	▲0.082
無コール残	95,838	78,572	86,108	78,820
ON	58,183	48,747	56,773	51,985
その他	37,655	29,825	29,335	26,835
有コール残	27,245	26,993	30,538	31,439

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。

### 2月18日の予定(時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
17:00	業態別の日銀当座預金残高(1月)	-	-	-
	-	-	-	-
	-	-	-	-

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	▲0.057	▲0.103
T/N	-	-	▲0.020	▲0.120
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.035	▲0.015	▲0.025	▲0.127
2W	▲0.040	▲0.020	▲0.036	▲0.134
3W	-	-	-	▲0.137
1M	▲0.035	▲0.015	▲0.032	▲0.144
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.164
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業協会公表

### 本日の市況

積み最終日となる本日の無担保コールON物は▲0.080%の出合から始まり、その後は主に▲0.086~▲0.015%の水準で出合が見られた。ON物が来積み期にもかかる取引であることからビッドが薄く、同加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.005%の▲0.057%と4営業日連続で低下した。

都銀・信託		証券	地銀
▲0.086 ~ ▲0.070		▲0.070 ~ ▲0.070	▲0.086 ~ ▲0.015

### 翌営業日のマーケット

新積み期に入るため、ビッドサイドは慎重な調達姿勢となると予想する。

### 資金需給

[億円]

	日銀速報 2月15日	日銀予想 2月18日	当社需給予想 2月19日
券	+200	+600	+0
財政	+84,700	▲9,000	+3,000
過不足	+84,900	▲8,400	+3,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国債買入	+5,900		
共通担保(全店)		▲700	+700
CP等買入	▲500	▲200	+2,000
ETF買入	+500		
国債補完供給	+100	▲200	+200
当座預金増減	+90,700	▲6,400	+3,000
当座預金残高	3,847,100	3,840,700	3,843,700
準備預金残高	3,360,300	主な需給要因	
積み終了先	3,360,300		
超過準備	3,360,200	10年物価連動	
非準備預金残高	486,800	国債発行	
準備預金進捗率	100.0%	国庫短期証券	
平均	100.0%	発行・償還(3M)	
乖離率	0.0%		

### 2月15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
国債補完供給(2/15~2/18)	57,026	234	234	▲0.600	▲0.600	
共通担保(全店)(2/18~3/4)	8,000	708	708			

マナタリーベース [億円]  
2月14日時点 4,869,700

所要 [億円]  
来積み期の所要準備額 2,820,500  
2月18日以降の残り所要積数 94,400  
平均 3,600

### 国庫短期証券入札予定

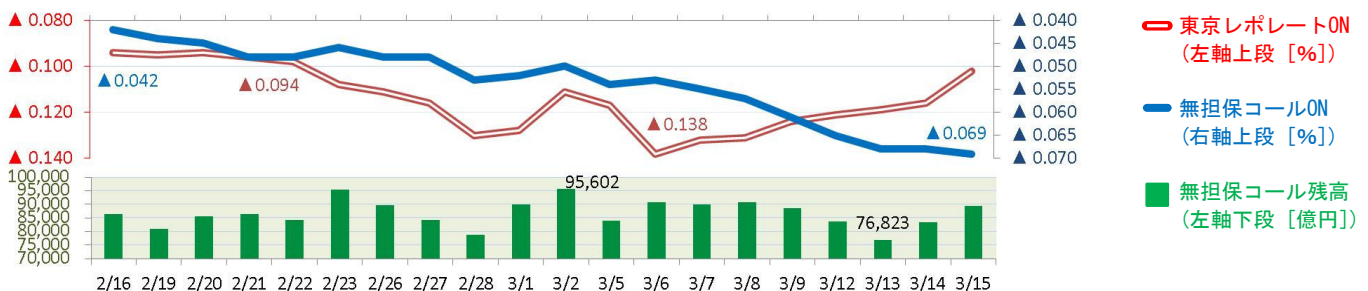
2月19日	1年	第815回
2月22日	3ヶ月	第816回
3月1日	3ヶ月	
3月7日	6ヶ月	
2月19日	20年	
2月28日	2年	
3月5日	10年	
3月7日	30年	

### 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	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2月積み期 [2月16日~3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。