

### 短期市場の推移

[億円] [%]

	2月15日	2月18日	2月19日	2月20日
加重平均金利	▲0.057	▲0.063	▲0.063	▲0.058
東京レポレート(ON)	▲0.103	▲0.101	▲0.106	▲0.102
無コール残	73,092	80,256	83,490	80,994
ON	50,427	53,741	56,725	54,549
その他	22,665	26,515	26,765	26,445
有コール残	18,783	23,491	17,667	26,611

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22日の予定(時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
8:30	1月消費者物価コア指数 [前年比]	+0.8%	0:00	(米)1月景気先行指数	0.2%
10:00	営業毎旬報告 (2月20日現在)	-	0:00	(米)1月中古住宅 販売件数	500万件
				NY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	▲0.056	▲0.102
T/N	▲0.040	▲0.020	▲0.027	▲0.110
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.020	▲0.015	▲0.017	▲0.117
2W	-	-	-	▲0.121
3W	-	-	▲0.025	▲0.125
1M	-	-	-	▲0.137
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.161
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

本日の無担保コールON物は▲0.060%の出合から始まった。その後は主に▲0.080~▲0.025%の水準で出合が見られた。同加重平均金利(速報)は、前営業日対比+0.002%の▲0.056%となった。

### 業態別出合レンジ

都銀・信託	証券	地銀
▲0.083 ~ ▲0.080	▲0.080 ~ ▲0.050	▲0.086 ~ ▲0.025

### 翌営業日のマーケット

週末3日積となることで若干出合のレートは上昇すると予想する。

### 資金需給

[億円]

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想
	2月21日	2月22日	2月21日	2月22日	2月25日
券	▲1,600	▲1,100	▲1,100	▲1,100	+0
財政	▲1,400	+1,000	+1,000	+1,000	▲2,000
過不足	▲3,000	▲100	▲100	▲100	▲2,000
金融調節	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド
国庫短期証券買入				+5,000	
共通担保(全店)					▲3,300
CP等買入	▲100		▲300		
社債等買入	▲200				+500
ETF買入		+600			
当座預金増減	▲2,700		+4,600		▲4,800
当座預金残高	3,830,700		3,835,300		3,830,500
準備預金残高	3,339,200				
積み終了先	3,336,400				
超過準備	3,333,200				
非準備先残高	491,500				
準備預金進捗率	99.6%				
平均	21.4%				
乖離率	78.2%				

2月21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

国庫短期証券買入(2/22~)	5,000	19,638	5,005	0.012	0.024	21.8
-----------------	-------	--------	-------	-------	-------	------

国債補完供給(2/21~2/22)	46,654	41	41	▲0.600	▲0.600
	10,000	2	2	▲0.600	▲0.600

マナタリーベース [億円]	所要 [億円]
2月20日時点 4,946,700	今積期の所要準備額 2,820,500
	2月22日以降の残り所要積数 10,300
	平均 500

### 国庫短期証券入札予定

2月22日	3ヶ月	第816回
3月1日	3ヶ月	
3月7日	6ヶ月	
3月8日	3ヶ月	
2月28日	2年	
3月5日	10年	
3月7日	30年	
3月12日	5年	

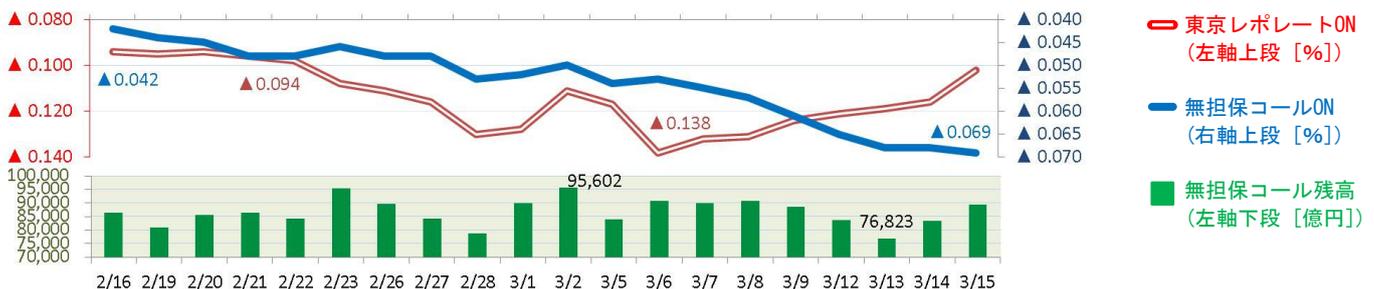
### 今月の国債買入オペ予定

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18日	1
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18日	1
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。