



### 短期市場の推移

	2月8日	2月9日	2月10日	2月14日
加重平均金利	▲0.020	▲0.020	▲0.022	▲0.019
東京レポレート(TN)	▲0.082	▲0.081	▲0.082	▲0.082
無コール残	175,373	171,822	180,499	135,720
ON	107,242	103,611	114,228	70,139
その他	68,131	68,211	66,271	65,581
有コール残	28,944	28,968	29,307	29,717

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。  
 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	▲0.080	0.001	▲0.010	▲0.085
T/N	-	-	▲0.008	▲0.086
S/N	-	-	▲0.005	-
1W	▲0.003	0.010	0.002	▲0.087
2W	▲0.040	▲0.002	▲0.035	▲0.087
3W	▲0.010	0.190	0.057	▲0.090
1M	▲0.040	0.150	▲0.002	▲0.092
2M	-	-	-	-
3M	-	-	0.005	▲0.102
6M	-	-	-	▲0.113
1Y	-	-	-	▲0.124

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

### 2月16日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	16:00 (英)1月消費者物価コア指数 [前年比]	-
-	-	22:30 (米)1月小売売上高	1.7%
-	-	23:15 (米)1月鉱工業生産指数 [前月比]	0.4%

経済指標及び予想値は株式会社フィスコ提供

### 本日の市況

1月積み期最終日である本日の無担保コールON物は▲0.01%の出合から始まり、その後は主に▲0.020%~▲0.005%のレンジで推移した。ビッドサイドの調達意欲が強く、本日の同加重平均金利(速報)は前営業日比+0.009%の▲0.010%(速報)となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.025 ~ ▲0.015	▲0.012 ~ ▲0.010	▲0.020 ~ ▲0.001

### 翌営業日のマーケット

新積み期に入り、運用ニーズの高まりが想定され、出合いの水準は本日比で低下すると予想。

### 資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想
	2月15日	2月16日	2月16日	2月17日	2月17日
券	+800	▲100	▲100	+0	+0
財政	+105,700	+12,700	+12,700	+9,000	+9,000
過不足	+106,500	+12,600	+12,600	+9,000	+9,000
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)			▲2,800	+2,600	
CP等買入	▲300		▲500	+5,000	
国債補完供給	+500	▲200	+200		
当座預金増減	+106,500	+22,100	+22,100	+9,000	+9,000
当座預金残高	5,366,400	5,388,500	5,388,500	5,397,500	5,397,500
準備預金残高	4,732,700				
積み終了先	4,732,700				
超過準備	4,732,700				
非準備先残高	633,700				
準備預金進捗率	100.0%				
平均	100.0%				
乖離率	0.0%				

### 2月15日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
国庫短期証券買入(2/16~)	5,000	21,964	5,002	0.007	0.007	83.2
米ドル資金供給(2/17~2/25)	1	1	0.340	0.340		
国債補完供給(2/15~2/16)	150	150	▲0.350	▲0.350		
共通担保(全店)(2/16~3/2)	20,000	2,551	2,551			

マネタリーベース (億円)  
 2月14日時点 6,497,600

所要	(億円)
来積み期の所要準備額	3,404,800
2月16日以降の残り所要	
積数	3,404,800
平均	121,600

### 国庫短期証券入札予定

2月17日	1年 (第1059回)
2月18日	3ヶ月(第1060回)
2月24日	6ヶ月
2月25日	3ヶ月

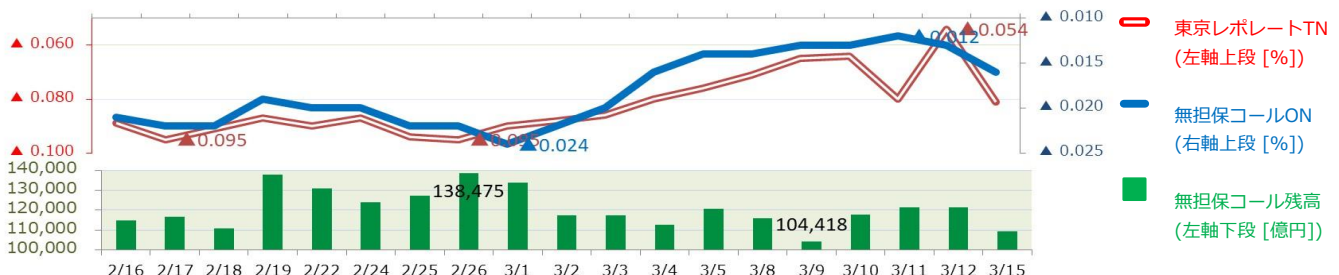
### 今月の国債買入オペ予定

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	1500	1,500	月1回	2月2日	0
1年超3年以下	4500	4,500	2 9 16 21	2月9日	2
3年超5年以下	4500	4,500	2 9 21 24	2月9日	2
5年超10年以下	4250	4,250	9 16 21 24	2月9日	3
10年超25年以下	1500	1,500	2	2月2日	0
25年超	500	500	16	1月17日	1
物価連動債	600	600	月1回	1月26日	1
変動利付債<四半期>	300	300	四半期に1回	1月20日	-

### 1年前の市場推移

○2021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。 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