



短期市場の推移

	2月10日	2月13日	2月14日	2月15日
加重平均金利	▲0.034	▲0.035	▲0.032	▲0.026
東京レボレート(TN)	▲0.106	▲0.091	▲0.092	▲0.092
無コール残	158,627	150,813	145,647	145,730
ON	91,590	84,126	79,010	80,298
その他	67,037	66,687	66,637	65,432
有コール残	26,768	28,930	29,174	29,134

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)			レボ市場
	最低	最高	平均	東京レボレート
O/N	▲0.065	0.001	▲0.010	▲0.087
T/N	-	-	▲0.010	▲0.087
S/N	-	-	▲0.005	-
1W	-	-	▲0.025	▲0.103
2W	▲0.025	▲0.001	▲0.014	▲0.114
3W	-	-	-	▲0.122
1M	▲0.015	▲0.007	▲0.010	▲0.135
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.147
6M	-	-	-	▲0.104
1Y	-	-	-	▲0.085

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17日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	18:00	(欧)12月経常収支
-	-	-	-
-	-	-	-

本日の市況

本日の無担保コールON物は▲0.010%の出合から始まり、その後は主に▲0.015%~▲0.005%の水準で取引された。2月積み期基準比率大幅上昇のためビッドサイドの調達意欲は旺盛であり、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.016%の▲0.010%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.020 ~ ▲0.007	- ~ -	▲0.020 ~ ▲0.005

翌営業日のマーケット

2月積み期最初の3日積みのため、レートは本日対比上昇を想定する。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	2月16日		2月17日		2月20日	
券	▲900		+0		+1,000	
財政	+900		▲16,700		▲16,000	
過不足	+0		▲16,700		▲15,000	
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
国債買入		+16,200		+300		
CP等買入	▲100		▲300			
社債等買入			▲100			
被災地金融機関支援			▲1,300			
国債補充供給	+50,300	▲55,300	+55,300			
当座預金増減	+11,100		+37,500		▲15,000	
当座預金残高	5,260,300		5,297,800		5,282,800	
準備預金残高	4,597,000		4,597,000		4,597,000	
積み終了先	3,433,800		国債発行(5年)		国庫短期証券発行・償還(3M)	
超過準備	1,395,100		国債発行(5年)		国庫短期証券発行・償還(1年)	
非準備預金残高	663,300		国債発行(5年)		国庫短期証券発行・償還(1年)	
準備預金進捗率	91.0%		国債発行(5年)		国庫短期証券発行・償還(1年)	
平均	3.6%		国債発行(5年)		国庫短期証券発行・償還(1年)	
乖離率	87.4%		国債発行(5年)		国庫短期証券発行・償還(1年)	

2月16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
------	------	----	----	----	----	----

国債買入(固定利回り方式)(2/17~)						
5~10年	300	300				
5~10年	0	0				

社債等買入(2/21~)	1,000	1,608	1,000	0.195	0.235	37.5
--------------	-------	-------	-------	-------	-------	------

国債補充供給(2/16~2/17)	55,753	55,753	▲0.350	▲0.351		
	0	0				

マナタリーベース	所要
2月15日時点	6,515,000
今積期の所要準備額	3,518,100
2月17日以降の残り所要	
積数	316,200
平均	11,700

国庫短期証券入札予定

2月17日	3ヶ月(第1140回)
2月24日	3ヶ月
3月3日	3ヶ月
3月8日	6ヶ月

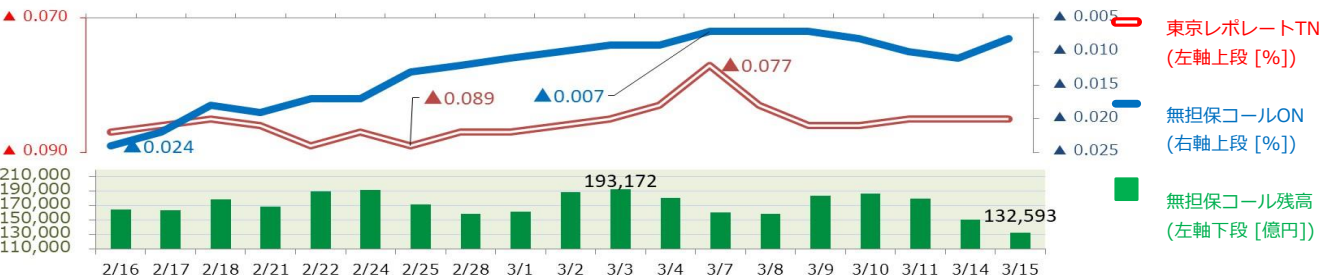
今月の国債買入オペ予定

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3日	0
1年超3年以下	4,250~5,750	4,250	3 8 15 20	2月15日	1
3年超5年以下	5,000~6,500	5,000	3 8 20 27	2月8日	2
5年超10年以下	5,750~7,750	6,750	8 15 20 27	2月15日	2
10年超25年以下	2,000~4,000	3,000	3 8 15 27	2月15日	1
25年超	1,000~3,000	2,000	3 15 20	2月15日	1
物価連動債	600	600	月1回	1月30日	-
変動利付債<四半期>	300	300	四半期に1回	1月12日	-

1年前の市場推移

○2022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