



### 短期市場の推移

	2月14日	2月15日	2月16日	2月17日
加重平均金利	▲0.032	▲0.026	▲0.010	▲0.007
東京レボレート(TN)	▲0.092	▲0.092	▲0.087	▲0.083
無コール残	145,647	145,730	161,106	161,475
ON	79,010	80,298	93,504	82,872
その他	66,637	65,432	67,602	78,603
有コール残	29,174	29,134	29,436	29,482

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	▲0.009	▲0.081
T/N	-	-	▲0.010	▲0.083
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	-	▲0.098
2W	▲0.010	▲0.008	▲0.008	▲0.109
3W	-	-	▲0.010	▲0.121
1M	-	-	-	▲0.134
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.146
6M	-	-	-	▲0.105
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21日の予定 (時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
	-			-	
	-			-	
	-			-	

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

本日の無担保コールON物は▲0.008%の合出から始まり、その後は主に▲0.010%~▲0.005%の水準で取引された。週末3日積み必要因剥落のため、一部ビッドサイドの調達意欲が減退しON物加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.002%の▲0.009%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.010 ~ ▲0.005	- ~ -	▲0.010 ~ ▲0.005

### 翌営業日のマーケット

オファービッド動向に大きな変化はなく出合いの水準は横ばいと予想する。

### 資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	2月20日	2月21日	2月21日	2月22日	2月22日	2月23日
券	▲500	▲400	▲400	▲400	▲400	+0
財政	▲18,600	+300	+300	+300	+300	▲8,000
過不足	▲19,100	▲100	▲100	▲100	▲100	▲8,000
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		+400		+18,000		
CP等買入	▲100		▲200			
社債等買入	▲300		+1,000			
国債補完供給	+53,900	+55,600	+55,600			
共通担保(全店)						▲2,800
当座預金増減	▲20,800	+74,300	+74,300			▲10,800
当座預金残高	5,223,600	5,297,900	5,297,900			5,287,100
準備預金残高	4,573,800					
積み終了先	4,568,700					
超過準備	4,568,600					
非準備先残高	649,800					
準備預金進捗率	99.3%					
平均	17.9%					
乖離率	81.5%					

### 2月20日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
国債買入(固定利回り方式)(2/21~)						
5~10年	538	538				
5~10年	0	0				
国債買入(2/21~)						
1~3年	4,250	8,349	4,257	0.002	0.002	69.3
3~5年	5,000	15,384	5,006	▲0.002	▲0.001	31.4
5~10年	6,750	16,148	6,764	▲0.002	▲0.001	94.9
25年~	1,500	2,994	1,505	0.000	0.003	89.9
国債補完供給(2/20~2/21)						
	56,020	56,020	▲0.350	▲0.353		
	0	0				

マナリーベース	所要
2月17日時点	6,511,000
今積期の所要準備額	3,518,100
2月21日以降の残り所要	
積数	24,200
平均	1,100

### 国債短期証券入札予定

2月24日	3ヶ月(第1141回)
3月3日	3ヶ月
3月8日	6ヶ月
3月9日	3ヶ月
2月21日	20年
2月28日	2年
3月2日	10年
3月7日	30年

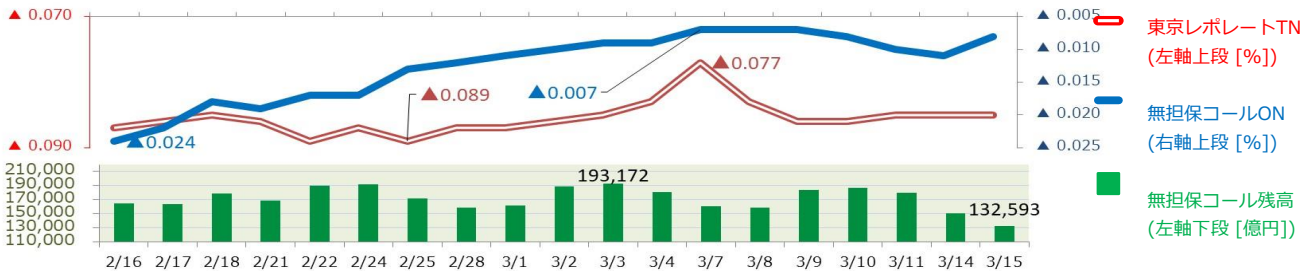
### 今月の国債買入オペ予定

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	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20日	0
3年超5年以下	5,000~6,500	5,000	3 8 20 27	2月20日	1
5年超10年以下	5,750~7,750	6,750	8 15 20 27	2月20日	1
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	1,500	3 15 20	2月20日	0
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