



## 短期市場の推移

[億円] [%]				
	2月12日	2月13日	2月16日	2月17日
加重平均金利	0.728	0.728	0.728	0.730
東京レボ レート(TN)	0.749	0.750	0.750	0.746
無コール残	97,668	100,234	105,762	104,257
ON	33,805	37,521	43,454	42,679
その他	63,863	62,713	62,308	61,578
有コール残	26,351	26,838	26,913	27,239

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	0.700	0.775	0.728	0.743
T/N	-	-	-	0.746
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	0.990	0.746
2W	0.722	0.735	0.729	0.746
3W	-	-	-	0.746
1M	-	-	0.810	0.748
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	0.793
6M	-	-	-	0.870
1Y	-	-	-	0.984

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

## 資金需給

[億円]

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	2月18日	2月19日	2月19日	2月20日	2月20日	2月21日
券						+0
財政						▲8,000
過不足						▲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						
共通担保(全店)	▲8,000	+8,000				
国債補完供給	+2,100	▲2,000	+2,000			
当座預金増減		▲36,100	+18,700			▲8,000
当座預金残高		4,586,400	4,605,100			4,597,100
準備預金残高		4,234,800				
積み終了先		4,188,800				
超過準備		4,156,600				
非準備先残高		351,600				
準備預金進捗率		98.4%				
平均		10.7%				
乖離率		87.7%				

## 国庫短期証券入札予定

2月19日	1年(第1363回)
2月20日	3ヶ月(第1364回)
2月27日	3ヶ月
3月6日	3ヶ月

## 国債入札予定

2月19日	20年
2月27日	2年
3月3日	10年
3月5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	1000	1,000	4	2月4日	0
1年超3年以下	2700	2,700	4 12 18	2月18日	0
3年超5年以下	2450	2,450	4 12 26	2月12日	1
5年超10年以下	2600	2,600	12 18 26	2月18日	1
10年超25年以下	950	950	4 12 26	2月12日	1
25年超	750	750	12 18	2月18日	0
物価連動債	400	400	26	1月29日	1
変動利付債	-	300	-	4月14日	-

## 2月19日の予定(時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
-	-	-	(米) 貿易収支(12月)	-	-
-	-	-	(欧) 経常収支(12月)	-	-
-	-	-	(欧) 消費者信頼感(2月)	-	-

## 本日の市況

無担保コールON物は0.727%の出合から始まり、その後も同程度で推移した。ON物加重平均金利(速報)は前営業対比▲0.002%の0.728%となった。

都銀・信託	証券	地銀
- ~ -	0.727 ~ 0.727	0.727 ~ 0.727

## 翌営業日のマーケット

出合いの水準は本日対比横ばい圏を予想する。

[%][億円]※米ドル資金供給は百万\$

## 2月18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(2/19~)

1~3年	2,700	6,080	2,701	0.005	0.007	100.0
5~10年	2,600	10,466	2,602	▲0.008	▲0.008	77.0
25年~	750	2,194	750	0.029	0.036	50.0

## 国債補完供給(2/18~2/19)

1,737	1,737	0.450	0.450
395	395	0.450	0.450

## マネタリーベース [億円]

2月17日時点 5,836,700

## 所要

今積期の所要準備額 3,731,900

2月19日以降の残り所要

積数 59,100

平均 2,400

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