



短期市場の推移

	2月13日	2月14日	2月17日	2月18日
加重平均金利	0.477	0.477	0.477	0.477
東京レボレート(TN)	0.351	0.431	0.441	0.448
無コール残	81,872	80,818	80,599	82,915
ON	36,863	35,749	34,750	36,996
その他	45,009	45,069	45,849	45,919
有コール残	38,650	39,664	39,416	37,464

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	0.450	0.525	0.477	0.489
T/N	-	-	-	0.474
S/N	-	-	-	-
1W	0.483	0.550	0.535	0.433
2W	-	-	-	0.425
3W	-	-	-	0.425
1M	-	-	-	0.428
2M	-	-	-	-
3M	-	-	0.615	0.450
6M	-	-	-	0.487
1Y	-	-	-	0.560

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20日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	-	-
-	-	-	-
-	-	-	-

本日の市況

無担保コールON物は0.477%の出合から始まり、その後は主に同水準を中心に取引された。ビットサイドの資金調達意欲は引き続き底堅く、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比横ばいの0.477%となった。

都銀・信託	証券	地銀
- ~ -	0.477 ~ 0.477	0.477 ~ 0.477

翌営業日のマーケット

ビットサイドの資金調達意欲は引き続き旺盛であるため、出合の水準は本日対比横ばい圏を予想する。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想
	2月19日		2月20日		2月21日
券		▲100		+500	+0
財政		▲900		+27,300	▲13,000
過不足		▲1,000		+27,800	▲13,000
金融調節	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド
国債買入				+9,700	
共通担保(全店)	▲8,000	+8,000			
CP等買入			▲200		
国債補充供給	+3,300	▲3,200	+3,200		
当座預金増減		▲900		+40,500	▲13,000
当座預金残高		5,269,400		5,309,900	5,296,900
準備預金残高		4,792,000			
積み終了先		4,777,300			
超過準備		4,776,700			
非準備先残高		477,400			
準備預金進捗率		99.2%			
平均		14.3%			
乖離率		84.9%			

2月19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(2/20~)						
1~3年	3,000	6,275	3,001	▲0.007	▲0.004	65.8
3~5年	3,000	8,352	3,008	▲0.014	▲0.013	56.9
5~10年	3,250	5,939	3,254	▲0.014	▲0.009	65.4
25年~	750	1,662	750	▲0.003	0.002	60.0
国債補充供給(2/19~2/20)						
	3,442	3,442	0.150	0.150		
	0	0				

マネタリーベース 【億円】
2月18日時点 6,511,300

所要	【億円】
今積期の所要準備額	3,681,900
2月20日以降の残り所要	
積数	30,900
平均	1,300

国庫短期証券入札予定

2月21日	3ヶ月(第1289回)
2月28日	3ヶ月
3月6日	6ヶ月
3月7日	3ヶ月
2月27日	2年
3月4日	10年
3月6日	30年
3月10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	1500	1,500	3	2月3日	0
1年超3年以下	3000	3,000	3 7 13 19	2月19日	0
3年超5年以下	3000	3,000	3 7 19 26	2月19日	1
5年超10年以下	3250	3,250	7 13 19 26	2月19日	1
10年超25年以下	1500	1,500	3 13 26	2月13日	1
25年超	750	750	13 19	2月19日	0
物価連動債	500	500	26	1月30日	1
変動利付債	-	300	-	4月14日	-

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