



短期市場の推移

	2月9日	2月10日	2月13日	2月14日
加重平均金利	▲0.036	▲0.034	▲0.035	▲0.032
東京レボレート(TN)	▲0.107	▲0.106	▲0.091	▲0.092
無コール残	158,568	158,627	150,813	145,647
ON	90,671	91,590	84,126	79,010
その他	67,897	67,037	66,687	66,637
有コール残	26,521	26,768	28,930	29,174

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	▲0.026	▲0.088
T/N	-	-	-	▲0.092
S/N	-	-	▲0.005	-
1W	▲0.030	▲0.015	▲0.029	▲0.106
2W	▲0.020	0.040	▲0.012	▲0.115
3W	-	-	▲0.008	▲0.121
1M	▲0.015	0.000	▲0.013	▲0.135
2M	-	-	-	-
3M	-	-	0.005	▲0.146
6M	-	-	-	▲0.104
1Y	-	-	-	▲0.081

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16日の予定 (時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
8:50	1月貿易収支	-38900億円	22:30	(米)2月フィラデルフィア運銀製造業景況指数 -7.4
	-	-	22:30	(米)新規失業保険申請件数 [前週分] -
	-	-		-

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▲0.025%の出合から始まり、その後は主に▲0.030%~▲0.020%の水準で取引された。1月積み期最終日の調整による調達ニーズの強まりから、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.006%の▲0.026%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.040 ~ ▲0.020	- ~ -	▲0.030 ~ ▲0.015

翌営業日のマーケット

新積み期初日となる翌営業日もビッドサイドの積極的な調達が想定され、出合いの水準は本日対比で上昇すると予想。

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	2月17日
券	▲400	▲900	▲900	▲1,000	▲1,000	▲1,000
財政	+73,000	+600	+600	+19,000	+19,000	+19,000
過不足	+72,600	▲300	▲300	▲20,000	▲20,000	▲20,000
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
国庫短期証券買入		+1,000				
国債買入				+16,200		
共通担保(全店)		+10,000				
CP等買入	▲500		▲100			
被災地金融機関支援					▲1,300	+300
国債補完供給	+53,300	▲52,400	+52,400			
当座預金増減	+84,000	+68,200	+68,200	▲21,000	▲21,000	▲21,000
当座預金残高	5,249,200	5,317,400	5,317,400	5,296,400	5,296,400	5,296,400
準備預金残高	4,633,500					
積み終了先	4,633,500					
超過準備	4,633,500					
非準備預金残高	615,700					
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
国債買入(固定利回り方式)(2/16~)						
5~10年	54	54				
5~10年	0	0				
国債買入(2/16~)						
1~3年	4,250	8,575	4,254	▲0.003	0.000	2.2
5~10年	6,750	16,247	6,758	▲0.003	▲0.002	78.4
10~25年	3,000	5,461	3,003	▲0.006	▲0.003	74.8
25年~	2,000	2,523	2,001	▲0.017	0.003	2.1
国債補完供給(2/15~2/16)						
52,842	52,842	▲0.350	▲0.351			
0	0					
被災地金融機関支援(2023/2/17~2025/2/17)	346	346				

マナタリーベース	所要
2月14日時点	6,430,600
来積期の所要準備額	3,518,100
2月16日以降の残り所要	
積数	3,518,100
平均	125,600

国庫短期証券入札予定

2月16日	1年(第1139回)
2月17日	3ヶ月(第1140回)
2月24日	3ヶ月
3月3日	3ヶ月

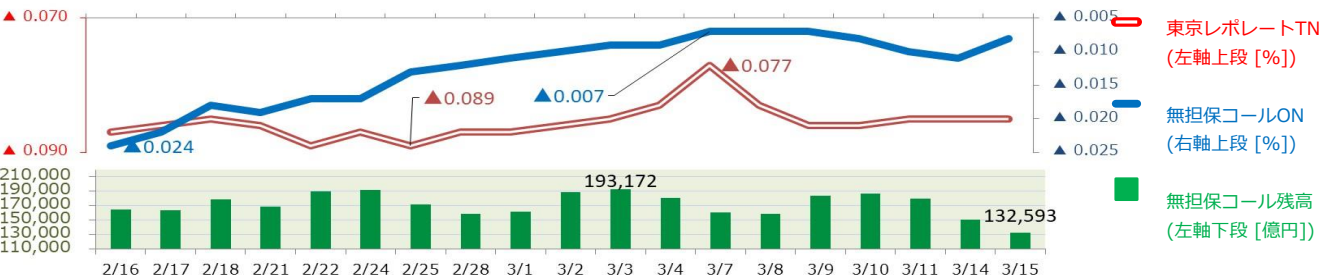
今月の国債買入オペ予定

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