



短期市場の推移

	2月17日	2月20日	2月21日	2月22日
加重平均金利	▲0.007	▲0.009	▲0.009	▲0.008
東京レボレート(TN)	▲0.083	▲0.083	▲0.082	▲0.082
無コール残	161,475	164,640	164,880	164,112
ON	82,872	84,607	84,177	84,579
その他	78,603	80,033	80,703	79,533
有コール残	29,482	28,342	31,827	29,046

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	▲0.060	0.001	▲0.009	▲0.081
T/N	-	-	▲0.010	▲0.084
S/N	-	-	▲0.005	-
1W	-	-	▲0.010	▲0.098
2W	▲0.015	▲0.007	▲0.014	▲0.106
3W	-	-	-	▲0.116
1M	▲0.006	0.180	0.002	▲0.132
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.145
6M	-	-	-	▲0.105
1Y	-	-	-	▲0.084

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27日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	22:30 (米)1月耐久財受注[前月比]	-3.5%
-	-	-	-
-	-	-	-

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▲0.006%の出合から始まり、その後は主に▲0.010%~▲0.005%の水準で取引された。3日積みではあったが、オファービッド共に主だった変化は見られず、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.001%の▲0.009%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.010 ~ ▲0.009	- ~ -	▲0.012 ~ ▲0.005

翌営業日のマーケット

オファービッド共に主だった変化は見られず、出合水準は本日対比横ばい圏を想定。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	2月24日	2月27日	2月27日	2月28日	2月28日	2月28日
券	▲500	▲400	▲500	▲500	▲500	▲500
財政	+8,000	▲2,100	+7,500	+7,500	+7,500	+7,500
過不足	+7,500	▲2,500	+7,000	+7,000	+7,000	+7,000
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		+5,500				
CP等買入	▲400		▲800			
社債等買入	▲200					
国債補充供給	+54,500	▲59,600	+59,600			
新型コロナ対応金融支援特別					▲14,500	
当座預金増減	+7,300	+56,300	+7,500	+7,500	+7,500	+7,500
当座預金残高	5,241,900	5,298,200	5,298,200	5,290,700	5,290,700	5,290,700
準備預金残高	4,586,900					
積み終了先	4,585,500					
超過準備	4,585,100					
非準備先残高	655,000					
準備預金進捗率	99.8%					
平均	39.3%					
乖離率	60.5%					

2月24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)(2/27~)						
5~10年	0	0				
5~10年	0	0				
国債補充供給(2/24~2/27)						
	60,227	60,227	▲0.350	▲0.354		
	0	0				

マナタリーベース	所要
2月22日時点	6,503,100
今積期の所要準備額	3,518,100
2月27日以降の残り所要	
積数	7,300
平均	400

国庫短期証券入札予定

3月3日	3ヶ月(第1142回)
3月8日	6ヶ月
3月9日	3ヶ月
3月16日	1年
2月28日	2年
3月2日	10年
3月7日	30年
3月14日	5年

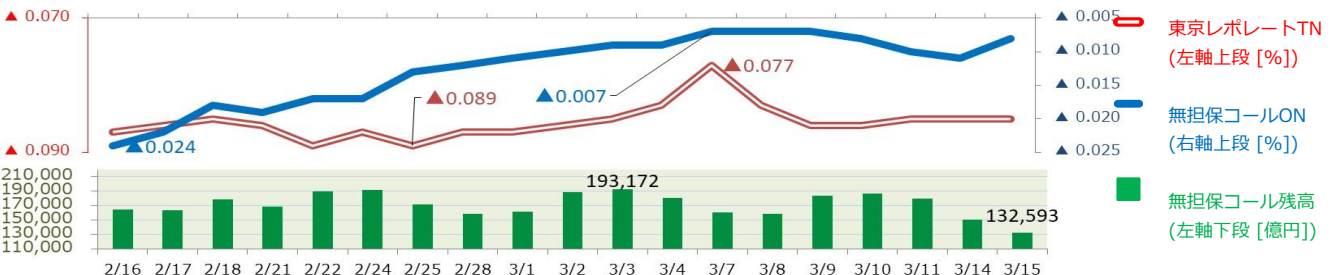
今月の国債買入オペ予定

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	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	3,000	8 15 20 27	2月22日	1
10年超25年以下	2,000~4,000	1,000	3 8 15 27	2月22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