



短期市場の推移

	2月21日	2月22日	2月24日	2月27日
加重平均金利	▲0.009	▲0.008	▲0.009	▲0.010
東京レボレート(TN)	▲0.082	▲0.082	▲0.084	▲0.087
無コール残	164,880	164,112	162,299	160,383
ON	84,177	84,579	83,531	85,795
その他	80,703	79,533	78,768	74,588
有コール残	31,827	29,046	28,830	29,103

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	▲0.087	0.001	▲0.011	▲0.087
T/N	-	-	▲0.010	▲0.087
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	-	▲0.096
2W	▲0.025	0.001	▲0.017	▲0.106
3W	-	-	0.100	▲0.115
1M	▲0.008	0.005	▲0.005	▲0.141
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.145
6M	-	-	-	▲0.107
1Y	-	-	-	▲0.083

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

3月1日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	0:00 (米)2月消費者信頼感指数	108.4
-	-	-	-
-	-	-	-

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▲0.010%の合出から始まり、その後は主に▲0.012%~▲0.007%の水準で取引された。オファービッドともに大きな動向の変化はなく、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.001%の▲0.011%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.012 ~ ▲0.010	- ~ -	▲0.012 ~ ▲0.007

翌営業日のマーケット

ビッドサイドの調達意欲が引き続き堅調ななか、出合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28日	3月1日	2月28日	3月1日	2月28日	3月1日
券		▲400		▲200		+0
財政		+9,200		▲31,200		▲50,000
過不足		+8,800		▲31,400		▲50,000
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		+16,000				
共通担保(全店)				+10,000		
CP等買入	▲3,100	+4,000				
社債等買入	▲300		▲100			
国債補完供給	+54,500	▲61,800	+67,100			
新型コロナ対応金融支援特別	▲14,500	+5,400				
当座預金増減		+9,000		+46,600		▲50,000
当座預金残高		5,248,800		5,295,400		5,245,400
準備預金残高		4,587,700				
積み終了先		4,586,500				
超過準備		4,586,300				
非準備先残高		661,100				
準備預金進捗率		99.9%				
平均		46.4%				
乖離率		53.5%				

2月28日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
国庫短期証券買入(3/1~)	1,000	4,546	1,000	0.004	0.006	
国債買入(固定利回り方式)(3/1~)						
5~10年		0	0			
5~10年		0	0			
米ドル資金供給(3/2~3/9)						
		2	2	4.830	4.830	
国債補完供給(2/28~3/1)						
	24,383	23,751	▲1.100	▲3.828		
	38,628	38,628	▲0.350	▲0.350		
	0	0				
共通担保(全店)(2023/3/1~2028/3/1)						
	10,000	30,245	10,010	0.110	0.133	3.8
米ドル資金供給用担保国債供給(3/1~3/10)						
	5,000	2	2	▲0.100	▲0.100	

マネタリーベース (億円)
 2月27日時点 6,509,100

所要	(億円)
今積期の所要準備額	3,518,100
3月1日以降の残り所要	
積数	2,900
平均	200

国庫短期証券入札予定

入札日	入札期間
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

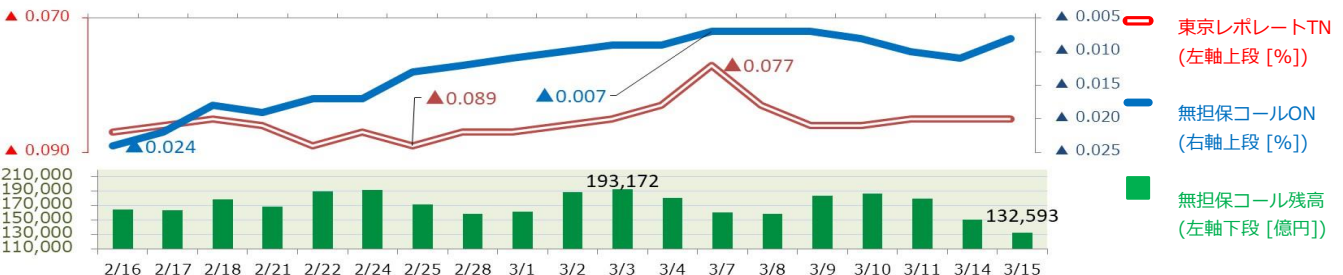
来月の国債買入オペ予定

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	1
1年超3年以下	4,250~5,750	4,250	3 8 15 20	2月20日	4
3年超5年以下	5,000~6,500	5,000	3 8 15 29	2月27日	4
5年超10年以下	5,750~7,750	6,750	8 15 20 29	2月27日	4
10年超25年以下	2,000~4,000	3,000	3 8 20 29	2月27日	4
25年超	1,000~3,000	1,500	3 15 20	2月20日	3
物価連動債	600	600	月1回	2月27日	1
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