



短期市場の推移

	2月6日	2月7日	2月8日	2月9日
加重平均金利	▲0.007	▲0.006	▲0.005	▲0.005
東京レボレート(TN)	▲0.082	▲0.090	▲0.074	▲0.053
無コール残	172,062	170,703	168,831	154,154
ON	84,094	83,885	85,773	77,806
その他	87,968	86,818	83,058	76,348
有コール残	28,944	29,738	29,496	30,125

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	▲0.086	0.001	▲0.005	▲0.070
T/N	-	-	▲0.003	▲0.062
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	▲0.001	▲0.072
2W	-	-	▲0.002	▲0.080
3W	-	-	-	▲0.086
1M	-	-	-	▲0.091
2M	-	-	-	-
3M	-	-	0.030	▲0.104
6M	-	-	-	▲0.079
1Y	-	-	-	▲0.045

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14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▲0.002%の合から始まり、その後は主に▲0.003%~▲0.002%を中心に取引された。引き続きビッドサイドの調達意欲は旺盛であり、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比横ばいの▲0.005%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.004 ~ ▲0.003	- ~ -	▲0.010 ~ ▲0.002

翌営業日のマーケット

引き続きビッドサイドの資金調達ニーズは底堅く、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13日		2月14日		2月15日
券	+200		+200		+0
財政	▲32,100		▲1,900		+68,000
過不足	▲31,900		▲1,700		+68,000
金融調節	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド
国庫短期証券買入				+1,000	
国債買現先		+29,800		▲29,800	
CP等買入	▲500		▲100		+4,000
国債補充供給	+33,400	▲35,800	+35,800		
当座預金増減	▲5,000		+9,200		+68,000
当座預金残高	5,348,700		5,357,900		5,425,900
準備預金残高	4,675,500		主な需給要因		
積み終了先	4,675,500		国債発行(10年)		
超過準備	4,675,400		CTB・個人		
非準備先残高	673,200		源泉税揚げ		
準備預金進捗率	100.0%		年金定時払い		
平均	93.5%				
乖離率	6.5%				

2月13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(2/14~)	1,000	5,831	1,000	0.023	0.024	33.0
米ドル資金供給(2/15~2/22)	1	1	5.580	5.580		
国債補充供給(2/13~2/14)	36,158	36,158	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マナタリーベース 【億円】
2月9日時点 6,613,100

所要	【億円】
今積期の所要準備額	4,044,000
2月14日以降の残り所要	
積数	0
平均	0

国庫短期証券入札予定

2月16日	3ヶ月(第1213回)
2月19日	1年(第1214回)
2月22日	3ヶ月
3月1日	3ヶ月

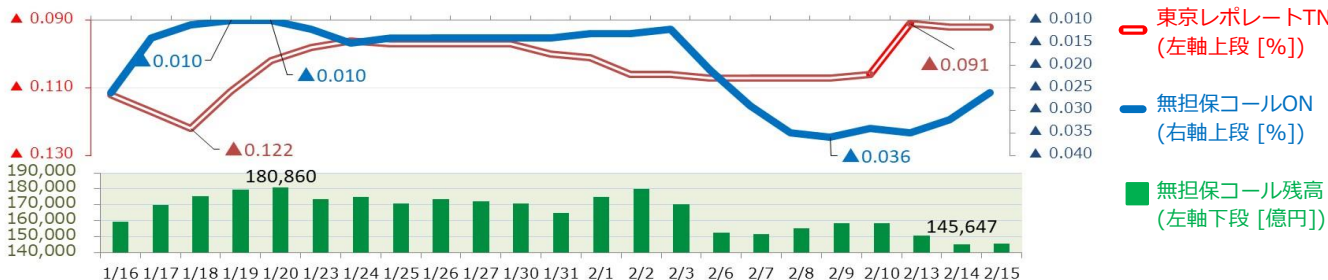
今月の国債買入オペ予定

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2日	0
1年超3年以下	3,000~6,500	3,750	2 8 15 21	2月8日	2
3年超5年以下	3,500~7,500	4,250	2 8 15 21	2月8日	2
5年超10年以下	4,000~9,000	4,750	2 8 21 28	2月8日	2
10年超25年以下	1,000~5,000	1,500	8 15 28	2月8日	2
25年超	500~3,500	750	15 28	1月29日	2
物価連動債	600	600	月1回	1月29日	1
変動利付債	-	300	-	4月14日	-

1年前の市場推移

○2023年1月積み期 [1月16日~2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