上田八木短資



デイリーシグナル

2024年2月15日(木)

短期	短期市場の推移 [億円][%]					
		2月8日	2月9日	2月13日	2月14日	
	重平均金利	▲0.005	▲0.005	▲0.005	▲0.005	
東京レボ レート(TN)		▲0.074	▲0.053	▲0.062	▲0.062	
無	コール残	168,831	154,154	156,667	148,433	
	ON	85,773	77,806	74,719	67,285	
	その他	83,058	76,348	81,948	81,148	
有	コール残	29,496	30,125	29,427	28,477	

加重平均金利・コール残高は日銀、東京レポ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

2月16日の予定 (時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
17:00	業態別の日銀当座預金残高 (1月)			-	
	-			-	
	-			-	

本日の市況

[%]

 $\triangle 0.043$

	無担保コール(速報)				
	最低	最高 平均		東京レポ	
				レート	
O/N	▲0.070	0.001	▲0.005	▲0.075	
T/N	-	-	▲0.003	▲0.083	
S/N	-	-	-	-	
1W	▲0.015	0.001	▲0.005	▲0.083	
2W	▲0.010	0.000	▲0.009	▲0.087	
3W	-	-	▲0.003	▲0.089	
1M	▲0.015	0.015	0.005	▲0.094	
2M	-	-	-	-	
3M	-	-	0.030	▲0.097	
6M	_		_	▲ 0.073	

無担保コールON物は▲0.002%の出合から始まり、その後は主に▲0.003%~▲0.001%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▲0.005%となった。

		[%]
都銀・信託	証券	地銀
▲ 0.002 ~ ▲ 0.002	- ~ -	▲0.010 ~ ▲ 0.002

翌営業日のマーケット

積み期初日のためビッドサイドの様子見姿勢が予想されるが、資金調達ニーズは旺盛であるため、 出合の水準は本日対比横ばい圏を予想する。

4m+0/0 —	ログ市却ソナロ和	まさしずし	トは日本証券業協会公表

無担保コール(速報)は	日銀、東京レポレ	- トは日本証券	养業協会公表				
資金需給						[億円]	
	日銀	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	2月:	15日	2月16日		2月19日		
券		▲100		+0		+(
財政		+65,900		+2,800	▲ 4,000		
過不足		+65,800		+2,800		▲ 4,000	
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				+10,300			
国債買現先		+24,400	▲54,000				
CP等買入	▲ 700		▲ 200				
国債補完供給	+31,900	▲35,200	+35,200				
貸出増加支援	▲300						
当座預金増減		+85,900		▲ 5,900		▲ 4,000	
当座預金残高		5,409,900		5,404,000		5,400,000	
準備預金残高		4,740,500	主な需給要因				
積み終了先		4,740,500			国庫短期証	券発行償還	
超過準備		4,740,500			(3	M)	
非準預先残高		669,400					
準備預金進捗率		100.0%					
平均		100.0%					
ナール ナ							

0.0%

 2月15日のオペ結果
 [%][億円]※米ドル資金供給は百万\$

オペ種類 オファー 応札 落札 足切 平均 按分

国債買入(2/16~)
1~3年 3,750 9,773 3,754 ▲0.009 ▲0.006 49.0
3~5年 4,250 11,842 4,256 ▲0.030 ▲0.028 11.9
10~25年 1,500 3,470 1,503 ▲0.026 ▲0.024 93.0
25年~ 750 2,581 755 ▲0.016 ▲0.012 4.6
国債補完供給(2/15~2/16)

35,585 35,585 ▲0.350 ▲0.350 0 0

マネタリーベー	ス [億円]
2月14日時点	6,582,800

所要		[億円]
	来積期の所要準備額	3,772,800
	2月16日以降の残り所要	
	積数	3,772,800
	平均	130,100

	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(第1215回)			
	3月1日	3ヶ月			
	国債入札予定				
1	2月20日	20年			
ı	2月27日	5年クライメート・トランジション			
ı	2月29日	2年			
ı	3日5日	10年			

乖離率

今月の国債買入オペ予定					[億円]
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15日	1
3年超5年以下	3,500~7,500	4,250	2 8 15 21	2月15日	1
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15日	1
25年超	500~3,500	750	15 28	2月15日	1
物価連動債	600	600	月1回	1月29日	1
変動利付倩	-	300	-	4月14日	-

1年前の市場推移 ○2023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。 ▲ 0.080 ▲ 0.005 東京レポレートTN ▲ 0.010 (左軸上段 [%]) ▲ 0.015 ▲ 0.090 ▲0.007 ▲0.082 **▲**0.082 ▲ 0.020 無担保コールON **▲** 0.025 **■** ▲ 0.100 ▲ 0.030 (右軸上段 [%]) ▲ 0.102 **▲** 0.110 190,000 ▲ 0.035 ▲0.033 ▲0.033 186.381 180,000 ■ 無担保コール残高 170,000 158,195 (左軸下段 [億円]) 160,000 150,000 2/16 2/17 2/20 2/21 2/22 2/24 2/27 2/28 3/1 3/2 3/3 3/6 3/7 3/8 3/9 3/10 3/13 3/14 3/15

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。