



短期市場の推移

	2月9日	2月13日	2月14日	2月15日
加重平均金利	▲0.005	▲0.005	▲0.005	▲0.005
東京レボレート(TN)	▲0.053	▲0.062	▲0.062	▲0.083
無コール残	154,154	156,667	148,433	150,598
ON	77,806	74,719	67,285	69,280
その他	76,348	81,948	81,148	81,318
有コール残	30,125	29,427	28,477	28,504

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	▲0.006	▲0.080
T/N	-	-	▲0.003	▲0.080
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.013	▲0.001	▲0.005	▲0.084
2W	▲0.010	0.000	▲0.007	▲0.089
3W	-	-	-	▲0.091
1M	▲0.013	0.010	▲0.003	▲0.095
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.095
6M	-	-	-	▲0.071
1Y	-	-	-	▲0.043

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19日の予定 (時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
8:50	機械受注 (12月)		(米) 休場	
	-		-	
	-		-	

本日の市況

無担保コールON物は▲0.003%の出合から始まり、その後は主に▲0.005%~▲0.003%を中心に取引された。積み初日のためビッドサイドの様子見姿勢もあり、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比0.001%低下の▲0.006%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.005 ~ ▲0.005	- ~ -	▲0.008 ~ ▲0.003

翌営業日のマーケット

ビッドサイドの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上昇を予想する。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	2月16日	2月19日	2月19日	2月20日	2月20日	2月20日
券		+0	+400	+0		+0
財政		+4,000	▲5,200	▲2,000		▲2,000
過不足		+4,000	▲4,800	▲2,000		▲2,000
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				
国債買戻先	▲54,000					
CP等買入	▲200					
国債補完供給	+35,200	▲38,000	+38,000			
当座預金増減		▲42,700	+33,200	▲2,000		
当座預金残高		5,367,200	5,400,400	5,398,400		
準備預金残高		4,697,600	主な需給要因			
積み終了先		4,681,100	国庫短期証券発行償還	国庫短期証券発行償還		
超過準備		3,458,500	(3M)	(1Y)		
非準備預金残高		669,600				
準備預金進捗率		98.5%				
平均		10.3%				
乖離率		88.2%				

2月16日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
社債等買入(2/21~)	1,000	0	1,000	1,591	1,000	0.292 0.316 55.4
国債補完供給(2/16~2/19)	38,315	38,315	▲0.350	▲0.350		
	38,315	38,315	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マネタリベース	所要
2月15日時点 6,668,700	今積期の所要準備額 3,772,800
	2月19日以降の残り所要
	積数 55,700
	平均 2,100

国庫短期証券入札予定

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
3月7日	6ヶ月
2月20日	20年
2月27日	5年クライメート・トランジション
2月29日	2年
3月5日	10年

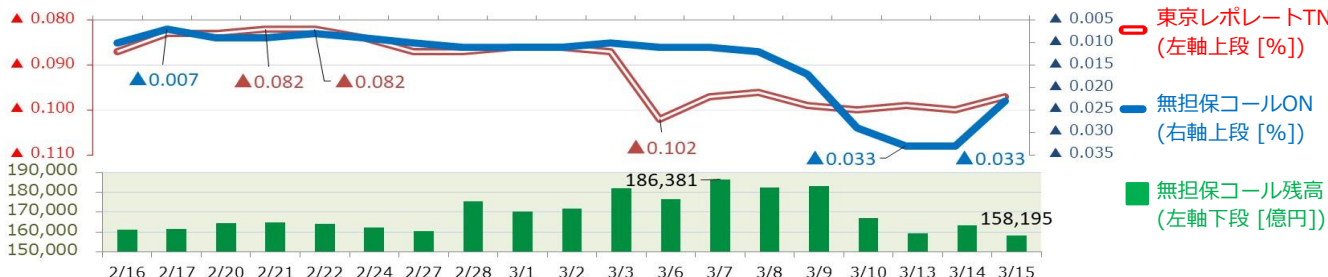
今月の国債買入オペ予定

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
2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
変動利付債	-	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。



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