



短期市場の推移 [億円] [%]

	2月13日	2月14日	2月15日	2月16日
加重平均金利	▲0.005	▲0.005	▲0.005	▲0.006
東京レポレート(TN)	▲0.062	▲0.062	▲0.083	▲0.080
無コール残	156,667	148,433	150,598	183,869
ON	74,719	67,285	69,280	92,211
その他	81,948	81,148	81,318	91,658
有コール残	29,427	28,477	28,504	30,110

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 [%]

	無担保コール(速報)			レポ市場
	最低	最高	平均	東京レポレート
O/N	▲0.085	0.001	▲0.006	▲0.092
T/N	-	-	▲0.003	▲0.091
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	-	▲0.092
2W	▲0.003	0.050	0.000	▲0.094
3W	-	-	-	▲0.096
1M	-	-	-	▲0.099
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.087
6M	-	-	-	▲0.067
1Y	-	-	-	▲0.029

無担保コール(速報)は日銀、東京レポレートは日本証券業協会公表

2月20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▲0.003%の出合から始まり、その後は主に▲0.008%~▲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▲0.006%となった。

	都銀・信託	証券	地銀
	- ~ -	- ~ -	▲0.008 ~ ▲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 [億円]

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	2月19日	2月20日	2月20日	2月21日	2月21日	2月22日
券		+400		▲400		+0
財政		▲5,200		▲2,900		▲17,000
過不足		▲4,800		▲3,300		▲17,000
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
共通担保(全店)					▲7,500	
CP等買入				▲100		
社債等買入				▲100		+1,000
国債補完供給	+38,000	▲36,600	+36,600			
当座預金増減		▲3,400		+33,100		▲23,500
当座預金残高		5,363,800		5,396,900		5,373,400
準備預金残高		4,688,400		4,675,000		4,675,000
積み終了先				国庫短期証券発行償還(1Y)		国債発行(20年)
超過準備		4,674,100				各種財政資金の貸付回収
非準備先残高		675,400				
準備預金進捗率		98.9%				
平均		13.8%				
乖離率		85.1%				

2月19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
国債補完供給(2/19~2/20)	36,926	36,926	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マネタリーベース [億円]
2月16日時点 6,626,100

所要	今積期の所要準備額
2月20日以降の残り所要	3,772,800
積数	41,100
平均	1,600

国庫短期証券入札予定

入札日	入札期間
2月22日	3ヶ月(第1215回)
3月1日	3ヶ月
3月7日	6ヶ月
3月8日	3ヶ月

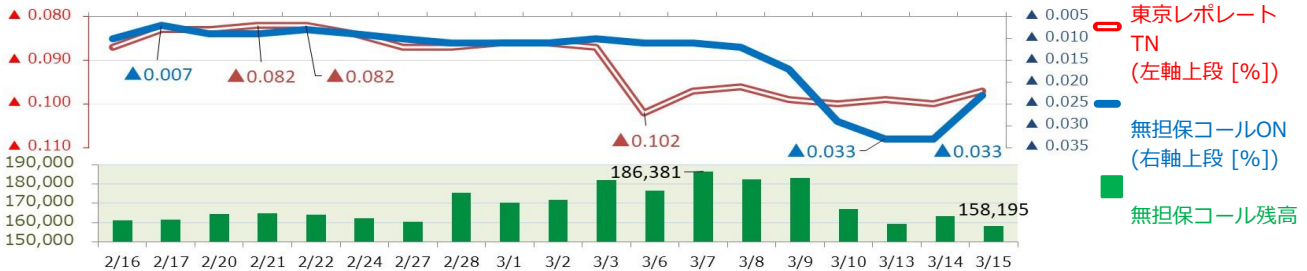
今月の国債買入オペ予定

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