



短期市場の推移

	2月19日	2月20日	2月21日	2月22日
加重平均金利	▲0.006	▲0.006	▲0.006	▲0.005
東京レボレート(TN)	▲0.091	▲0.099	▲0.105	▲0.105
無コール残	173,424	178,939	175,540	178,847
ON	82,866	86,216	83,777	93,464
その他	90,558	92,723	91,763	85,383
有コール残	29,160	30,101	30,860	30,931

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	▲0.092
T/N	-	-	▲0.002	▲0.100
S/N	-	-	0.001	-
1W	▲0.010	0.001	▲0.001	▲0.098
2W	-	-	▲0.001	▲0.101
3W	-	-	-	▲0.104
1M	-	-	▲0.002	▲0.105
2M	-	-	-	-
3M	0.028	0.100	0.064	▲0.066
6M	-	-	-	▲0.041
1Y	-	-	-	0.010

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27日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	(米) 消費者信頼感指数 (2月)	-
-	-	-	-
-	-	-	-

本日の市況

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▲0.005%~▲0.002%を中心に取引された。週末4日積み要因剥落のため、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.001%の▲0.006%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.010 ~ ▲0.010	- ~ -	▲0.005 ~ ▲0.002

翌営業日のマーケット

引き続きビットサイドの調達意欲は底堅く、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26日	2月27日	2月27日	2月28日	2月28日
券		+200	▲200		+0
財政		▲3,200	+1,800		▲7,000
過不足		▲3,000	+1,600		▲7,000
金融調節	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド
CP等買入	▲300				
国債補充供給	+34,100	▲33,500	+33,500		
当座預金増減		▲2,700	+35,100		▲7,000
当座預金残高		5,369,600	5,404,700		5,397,700
準備預金残高		4,684,600			主な需給要因
積み終了先		4,683,400			国債発行(5年CTB)
超過準備		4,682,500			
非準備先残高		685,000			
準備預金進捗率		99.6%			
平均		37.9%			
乖離率		61.7%			

2月26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
CP等買入(2/29~)	4,000	8,268	3,990	0.011	0.030	19.5
国債補充供給(2/26~2/27)		33,726	33,726	▲0.350	▲0.350	
		133	133	▲0.350	▲0.350	

マネタリーベース 【億円】
 2月22日時点 6,632,600

所要	【億円】
今積期の所要準備額	3,772,800
2月27日以降の残り所要	
積数	13,500
平均	800

国庫短期証券入札予定

3月1日	3ヶ月(第1216回)
3月7日	6ヶ月
3月8日	3ヶ月
3月15日	3ヶ月
2月27日	5年プライマート・トランザクション
2月29日	2年
3月5日	10年
3月7日	30年

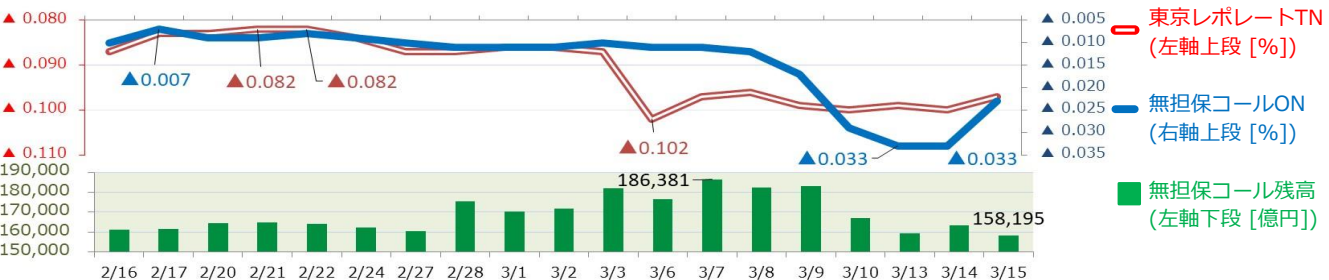
今月の国債買入オペ予定

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
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21日	0
3年超5年以下	3,500~7,500	4,250	2 8 15 21	2月21日	0
5年超10年以下	4,000~9,000	4,750	2 8 21 28	2月21日	1
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