



短期市場の推移

	2月21日	2月22日	2月26日	2月27日
加重平均金利	▲0.006	▲0.005	▲0.006	▲0.006
東京レボレート(TN)	▲0.105	▲0.105	▲0.100	▲0.103
無コール残	175,540	178,847	171,132	177,073
ON	83,777	93,464	87,859	92,330
その他	91,763	85,383	83,273	84,743
有コール残	30,860	30,931	27,676	26,772

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	▲0.087	0.003	▲0.006	▲0.100
T/N	-	-	▲0.002	▲0.109
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.004	0.001	▲0.002	▲0.099
2W	-	-	-	▲0.099
3W	-	-	-	▲0.100
1M	-	-	0.005	▲0.100
2M	-	-	-	-
3M	-	-	0.110	▲0.059
6M	-	-	-	▲0.036
1Y	-	-	-	0.012

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29日の予定 (時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
8:50	鉱工業生産 (1月)			-
	-			-
	-			-

本日の市況

無担保コールON物は▲0.003%の合出から始まり、その後は主に▲0.007%~▲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
▲0.010 ~ ▲0.010	- ~ -	▲0.007 ~ ▲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28日	2月29日	2月29日	3月1日	3月1日
券		+0	▲100	▲1,000	
財政	▲5,400	+11,400	▲35,000		
過不足	▲5,400	+11,300	▲36,000		
金融調節	エンド	スタート	エンド	スタート	スタート
国庫短期証券買入		+1,000			
国債買入			+7,500		
CP等買入	▲300		▲2,700	+4,000	
社債等買入	▲200				
国債補充供給	+34,000	▲34,600	+34,600		
当座預金増減		▲5,500	+54,700	▲36,000	
当座預金残高		5,364,200	5,418,900	5,382,900	
準備預金残高		4,692,100			主な需給要因
積み終了先		4,690,400			国債発行(2年)
超過準備		4,690,400			
非準備預金残高		672,100			
準備預金進捗率		99.7%			
平均		44.8%			
乖離率		54.9%			

2月28日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
国債買入(2/29~)						
5~10年	4,750	8,922	4,752	0.005	0.009	80.7
10~25年	1,500	2,665	1,504	0.021	0.024	56.3
25年~	750	2,480	753	0.034	0.035	4.6
物価連動	600	2,821	600	▲0.560	▲0.570	12.5
国債補充供給(2/28~2/29)						
	34,962	34,962	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マネタリーベース (億円)
 2月27日時点 6,629,900

所要	(億円)
今積期の所要準備額	3,772,800
2月29日以降の残り所要	
積数	10,600
平均	700

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

国債入札予定

2月29日	2年
3月5日	10年
3月7日	30年
3月12日	5年

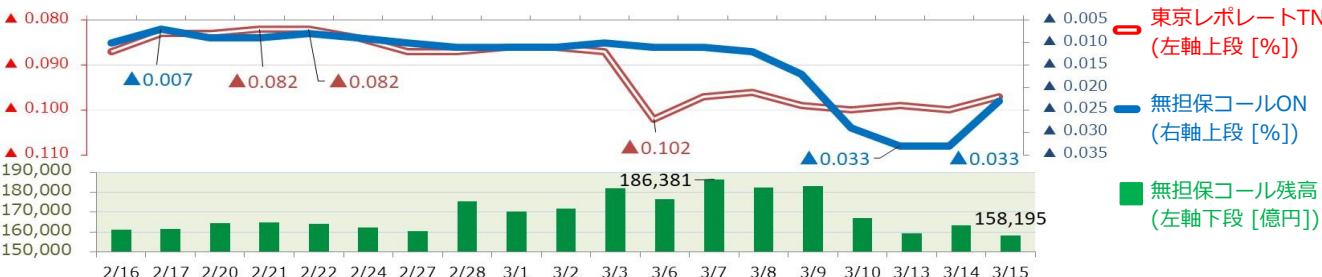
今月の国債買入オペ予定

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28日	0
10年超25年以下	1,000~5,000	1,500	8 15 28	2月28日	0
25年超	500~3,500	750	15 28	2月28日	0
物価連動債	600	600	月1回	2月28日	0
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