



短期市場の推移

	2月18日	2月19日	2月20日	2月21日
加重平均金利	0.477	0.477	0.477	0.478
東京レボレート(TN)	0.448	0.474	0.486	0.496
無コール残	82,915	80,840	80,758	81,804
ON	36,996	35,541	35,269	36,345
その他	45,919	45,299	45,489	45,459
有コール残	37,464	37,792	36,810	36,897

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	0.450	0.525	0.479	0.492
T/N	-	-	-	0.491
S/N	-	-	-	-
1W	0.550	0.560	0.551	0.445
2W	-	-	-	0.441
3W	0.550	0.580	0.560	0.439
1M	-	-	-	0.435
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	0.457
6M	-	-	-	0.489
1Y	-	-	-	0.577

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26日の予定 (時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
14:00	基調的なインフレ率を捕捉するための指標 (1月)			
	-		-	
	-		-	

本日の市況

無担保コールON物は0.477%の出合から始まり、その後は主に同水準を中心に取引された。ビットサイドの資金調達意欲は引き続き底堅く、一部金融機関による試し取りが行われたことから、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.001%の0.479%となった。

都銀・信託			証券	地銀
-	~	-	0.477 ~ 0.477	0.477 ~ 0.477

翌営業日のマーケット

ビットサイドの資金調達意欲は引き続き旺盛であるため、出合の水準は本日対比横ばい圏を予想する。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想
	2月25日	2月26日	2月26日	2月27日	2月27日
券		▲100	+200		+0
財政		+25,700	▲2,000		+8,000
過不足		+25,600	▲1,800		+8,000
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	▲200				
社債等買入	▲200				
国債補完供給	+3,300	▲5,500	+5,500		
当座預金増減		+23,000	+3,700		+8,000
当座預金残高		5,318,700	5,322,400		5,330,400
準備預金残高		4,848,300			主な需給要因
積み終了先		4,846,900			流動性供給
超過準備		4,846,900			
非準備先残高		470,400			
準備預金進捗率		99.8%			
平均		35.7%			
乖離率		64.1%			

2月25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
米ドル資金供給(2/27~3/6)	0	0	4,580	4,580		
国債補完供給(2/25~2/26)	5,748	5,748	0.250	0.250		
	0	0				

マナタリーベース [億円]
 2月21日時点 6,536,300

所要	所要
今積期の所要準備額	3,681,900
2月26日以降の残り所要	
積数	6,300
平均	300

国庫短期証券入札予定

2月28日	3ヶ月(第1290回)
3月6日	6ヶ月
3月7日	3ヶ月
3月14日	3ヶ月

国債入札予定

2月27日	2年
3月4日	10年
3月6日	30年
3月10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	3		2月3日 0
1年超3年以下	3000	3,000	3 7 13 19		2月19日 0
3年超5年以下	3000	3,000	3 7 19 26		2月19日 1
5年超10年以下	3250	3,250	7 13 19 26		2月19日 1
10年超25年以下	1500	1,500	3 13 26		2月13日 1
25年超	750	750	13 19		2月19日 0
物価連動債	500	500	26		1月30日 1
変動利付債	-	300	-		4月14日 -

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