



短期市場の推移

	2月18日	2月19日	2月20日	2月24日
加重平均金利	0.728	0.728	0.729	0.727
東京レボレート(TN)	0.746	0.750	0.750	0.750
無コール残	104,277	103,775	107,132	102,614
ON	41,799	41,297	45,934	41,366
その他	62,478	62,478	61,198	61,248
有コール残	25,237	25,515	26,768	26,372

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。無担保コール残は無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	0.700	0.775	0.729	0.747
T/N	-	-	-	0.750
S/N	-	-	-	-
1W	0.725	0.800	0.750	0.747
2W	0.710	0.830	0.728	0.747
3W	-	-	-	0.747
1M	0.810	1.150	0.946	0.748
2M	-	-	-	-
3M	-	-	1.000	0.803
6M	-	-	-	0.874
1Y	-	-	-	0.989

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
10:30	高田日銀審議委員の講演			-	
	-			-	
	-			-	

本日の市況

無担保コールON物は0.727%の出合から始まり、その後も同程度で推移した。ON物加重平均金利(速報)は前営業対比+0.002%の0.729%となった。

都銀・信託	証券	地銀
- ~ -	0.727 ~ 0.727	0.727 ~ 0.727

翌営業日のマーケット

出合い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	+700	▲200	▲200	+100	+100
財政	+8,500	▲1,600	▲1,600	+7,100	+7,100
過不足	+9,200	▲1,800	▲1,800	+7,200	+7,200
金融調節	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド
国債補完供給	+3,800	▲3,600	+3,600		
社債等買入	▲200		▲100		
当座預金増減	+9,200	+1,700	+1,700	+7,200	+7,200
当座預金残高	4,605,900	4,607,600	4,607,600	4,614,800	4,614,800
準備預金残高	4,259,300				
積み終了先	4,258,700				
超過準備	4,258,700				
非準備先残高	346,600				
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

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
国債補完供給(2/25~2/26)	3,851	3,851	0.550	0.550		
	1	1	0.550	0.550		

マネタリーベース 【億円】
2月24日時点 5,812,900

所要	【億円】
今積期の所要準備額	3,731,900
2月26日以降の残り所要	
積数	6,700
平均	400

国庫短期証券入札予定

2月27日	3ヶ月(第1365回)
3月6日	3ヶ月
3月9日	6ヶ月
3月13日	3ヶ月
国債入札予定	
2月27日	2年
3月3日	10年
3月5日	30年
3月11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	1000	1,000	4		2月4日 0
1年超3年以下	2700	2,700	4 12 18		2月18日 0
3年超5年以下	2450	2,450	4 12 26		2月12日 1
5年超10年以下	2600	2,600	12 18 26		2月18日 1
10年超25年以下	950	950	4 12 26		2月12日 1
25年超	750	750	12 18		2月18日 0
物価連動債	400	400	26		1月29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