



短期市場の推移

	2月1日	2月2日	2月5日	2月6日
加重平均金利	▲0.010	▲0.008	▲0.008	▲0.007
東京レボレート(TN)	▲0.080	▲0.071	▲0.083	▲0.082
無コール残	156,433	155,371	157,008	172,062
ON	73,675	72,573	73,060	84,094
その他	82,758	82,798	83,948	87,968
有コール残	30,079	31,937	29,704	28,944

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	0.001	▲0.006	▲0.082
T/N	-	-	▲0.003	▲0.090
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.010	0.030	▲0.002	▲0.089
2W	-	-	▲0.010	▲0.093
3W	-	-	-	▲0.099
1M	-	-	-	▲0.104
2M	-	-	-	-
3M	-	-	0.480	▲0.121
6M	-	-	-	▲0.089
1Y	-	-	-	▲0.051

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8日の予定(時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
8:50	国際収支(12月)		-	
14:00	景気ウォッチャー調査(1月)		-	
	-		-	

本日の市況

無担保コールON物は▲0.003%の合から始まり、その後は主に▲0.006%~▲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旺盛であり、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比0.001%上昇の▲0.006%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.009 ~ ▲0.009	- ~ -	▲0.010 ~ ▲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7日	2月8日	2月8日	2月9日	2月9日
券		+400		+500	+0
財政		+4,600		▲9,400	+2,000
過不足		+5,000		▲8,900	+2,000
金融調節	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド
国庫短期証券買入		+1,000			
共通担保(全店)	▲8,500	+7,500			
CP等買入			▲100		
国債補完供給	+33,200	▲33,300	+33,300		
当座預金増減		+4,900		+24,300	+2,000
当座預金残高		5,345,700		5,370,000	5,372,000
準備預金残高		4,671,600			
積み終了先		4,670,900			
超過準備		4,670,900			
非準備先残高		674,100			
準備預金進捗率		99.9%			
平均		74.2%			
乖離率		25.7%			

2月7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(2/7~2/8)	33,624	33,624	▲0.350	▲0.351		
	5	5	▲0.350	▲0.350		

マナリーベース	所要
2月6日時点	6,601,800

所要	所要
今積期の所要準備額	4,044,000
2月8日以降の残り所要	
積数	1,900
平均	200

国庫短期証券入札予定

2月8日	6ヶ月(第1211回)
2月9日	3ヶ月(第1212回)
2月16日	3ヶ月
2月19日	1年
2月9日	5年
2月14日	10年プライメート・トランジション
2月20日	20年
2月27日	5年プライメート・トランジション

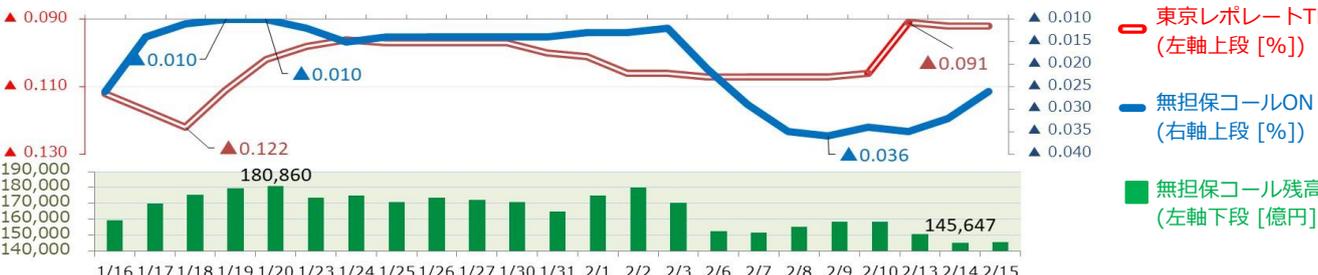
今月の国債買入オペ予定

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2日	3
3年超5年以下	3,500~7,500	4,250	2 8 15 21	2月2日	3
5年超10年以下	4,000~9,000	4,750	2 8 21 28	2月2日	3
10年超25年以下	1,000~5,000	1,500	8 15 28	1月24日	3
25年超	500~3,500	750	15 28	1月29日	2
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1月積み期 [1月16日~2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。