



短期市場の推移

	2月14日	2月15日	2月16日	2月19日
加重平均金利	▲0.005	▲0.005	▲0.006	▲0.006
東京レボレート(TN)	▲0.062	▲0.083	▲0.080	▲0.091
無コール残	148,433	150,598	183,869	173,424
ON	67,285	69,280	92,211	82,866
その他	81,148	81,318	91,658	90,558
有コール残	28,477	28,504	30,110	29,160

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	▲0.095
T/N	-	-	▲0.003	▲0.099
S/N	-	-	▲0.002	-
1W	▲0.015	▲0.001	▲0.009	▲0.098
2W	▲0.001	0.005	0.001	▲0.098
3W	-	-	0.001	▲0.100
1M	-	-	-	▲0.104
2M	-	-	-	-
3M	-	-	0.030	▲0.075
6M	-	-	-	▲0.059
1Y	-	-	-	▲0.004

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21日の予定 (時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
8:50	貿易収支 (1月)		(米) FOMC議事録 (1月30日・31日分)	
	-		(欧) 消費者信頼感指数 (2月)	
	-		-	

本日の市況

無担保コールON物は▲0.003%の合から始まり、その後は主に▲0.008%~▲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
	▲0.005 ~ ▲0.004	- ~ -	▲0.008 ~ ▲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20日	2月21日	2月21日	2月22日	2月22日
券		▲500		▲300	▲1,000
財政		▲4,400		▲18,000	+14,000
過不足		▲4,900		▲18,300	+13,000
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)			▲7,500	+7,100	
CP等買入	▲100		▲500		
社債等買入	▲100			+1,000	
国債補充供給	+36,600	▲35,000	+35,000		
当座預金増減		▲3,500		+17,800	+13,000
当座預金残高		5,360,300		5,378,100	5,391,100
準備預金残高		4,685,500			
積み終了先		4,677,400	国債発行(20年)		各種財政資金の支払い
超過準備		4,676,300	各種財政資金の貸付		取
非準備先残高		674,800			
準備預金進捗率		99.2%			
平均		17.2%			
乖離率		81.9%			

2月20日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
国庫短期証券買入(2/21~)	1,000	6,255	1,000	0.027	0.047	71.0
米ドル資金供給(2/22~2/29)	8	8	5.580	5.580		
国債補充供給(2/20~2/21)	35,291	35,291	▲0.350	▲0.350		
共通担保(全店)(2/21~3/6)	28	28	▲0.350	▲0.350		
米ドル資金供給用担保国債供給(2/21~3/1)	7,122	7,122				
	5,000	2	2	▲0.100	▲0.100	

マネタリーベース (億円)
2月19日時点 6,622,300

所要	(億円)
今積期の所要準備額	3,772,800
2月21日以降の残り所要	
積数	31,900
平均	1,300

国庫短期証券入札予定

入札日	3ヶ月(第1215回)
2月22日	3ヶ月
3月1日	6ヶ月
3月7日	3ヶ月

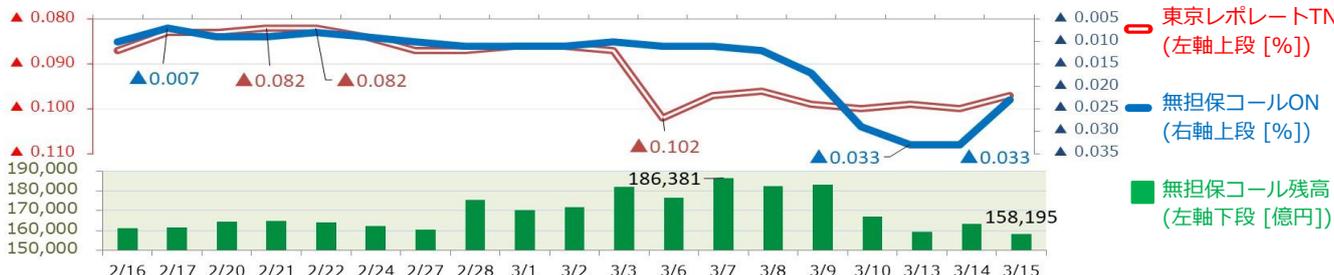
今月の国債買入オペ予定

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