



短期市場の推移

	2月22日	2月26日	2月27日	2月28日
加重平均金利	▲0.005	▲0.006	▲0.006	▲0.006
東京レボレート(TN)	▲0.105	▲0.100	▲0.103	▲0.109
無コール残	178,847	171,132	177,073	182,131
ON	93,464	87,859	92,330	97,178
その他	85,383	83,273	84,743	84,953
有コール残	30,931	27,676	26,772	28,449

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	▲0.005	▲0.100
T/N	-	-	▲0.001	▲0.106
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.007	▲0.003	▲0.006	▲0.100
2W	-	-	▲0.010	▲0.099
3W	-	-	▲0.001	▲0.100
1M	▲0.001	0.170	0.024	▲0.099
2M	-	-	0.055	-
3M	-	-	-	▲0.055
6M	-	-	-	▲0.033
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

3月1日の予定 (時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
8:30	完全失業率 (1月)		(米) ISM製造業指数 (2月)	
8:30	有効求人倍率 (1月)		(米) 製造業PMI (2月)	
	-	-	(欧) 製造業PMI (2月)	

本日の市況

無担保コールON物は▲0.002%の合から始まり、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0.001%上昇の▲0.005%となった。

	都銀・信託	証券	地銀
	- ~ -	- ~ -	▲0.010 ~ ▲0.001

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29日	3月1日	3月4日
券	+0	▲200	+1,000
財政	+14,500	▲31,500	▲46,000
過不足	+14,500	▲31,700	▲45,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国債買入	+7,500		
CP等買入	▲2,700	▲4,000	▲200
国債補充供給	+34,600	▲36,700	+36,700
成長基盤強化支援			▲2,200
当座預金増減	+21,200	+4,800	▲47,200
当座預金残高	5,385,400	5,390,200	5,343,000
準備預金残高	4,697,100	主な需給要因	
積み終了先	4,695,600	国債発行 (2年)	国庫短期証券発行償還 (3M)
超過準備	4,695,600		法人税・消費税・保険 揚げ
非準備先残高	688,300		
準備預金進捗率	99.8%		
平均	48.3%		
乖離率	51.5%		

2月29日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
国債補充供給(2/29~3/1)	37,048	37,048	▲0.350	▲0.350		
	1	1	▲0.350	▲0.350		

マネタリベース (億円)

2月28日時点 6,624,400

所要 (億円)

今積期の所要準備額	3,772,800
3月1日以降の残り所要	
積数	9,000
平均	600

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(第1217回)
3月8日	3ヶ月
3月15日	3ヶ月

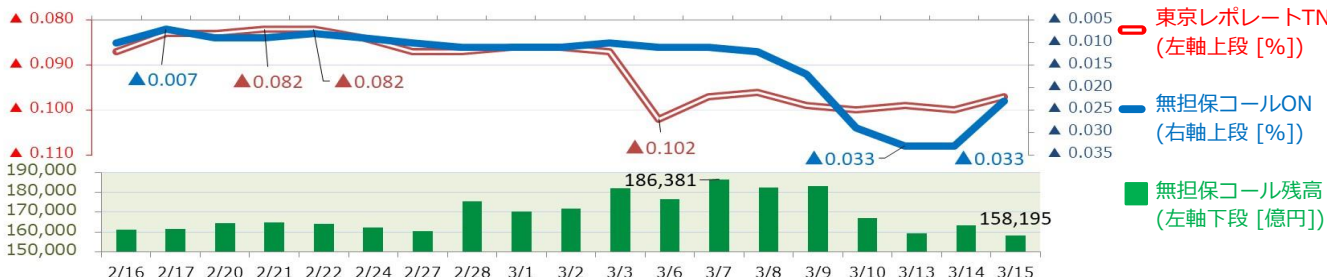
来月の国債買入オペ予定

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	1
1年超3年以下	3,000~6,500	3,750	4 8 15 22	2月21日	4
3年超5年以下	3,500~7,500	4,250	8 15 22 28	2月21日	4
5年超10年以下	4,000~9,000	4,750	8 15 22 28	2月28日	4
10年超25年以下	1,000~5,000	1,500	4 22 28	2月28日	3
25年超	500~3,500	750	4 15	2月28日	2
物価連動債	600	600	月1回	2月28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。