



短期市場の推移

	2月26日	2月27日	2月28日	2月29日
加重平均金利	▲0.006	▲0.006	▲0.006	▲0.005
東京レポレート(TN)	▲0.100	▲0.103	▲0.109	▲0.106
無コール残	171,132	177,073	182,131	166,759
ON	87,859	92,330	97,178	91,816
その他	83,273	84,743	84,953	74,943
有コール残	27,676	26,772	28,449	26,053

加重平均金利・コール残高は日銀、東京レポ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)			レポ市場
	最低	最高	平均	東京レポレート
O/N	▲0.087	0.001	▲0.005	▲0.099
T/N	-	-	▲0.002	▲0.100
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.040	0.001	▲0.035	▲0.099
2W	▲0.013	0.200	0.002	▲0.099
3W	-	-	-	▲0.100
1M	0.020	0.310	0.072	▲0.099
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.053
6M	-	-	-	▲0.033
1Y	-	-	-	0.012

無担保コール(速報)は日銀、東京レポレートは日本証券業協会公表

3月4日の予定(時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
8:50	マネタリーベース(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▲0.005%~▲0.002%を中心に取引された。週末要因もあり、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)は前営業日対比横這いの▲0.005%となった。

	都銀・信託	証券	地銀
	- ~ -	- ~ -	▲0.009 ~ ▲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
	3月1日	3月4日	3月5日
券	▲100	+400	+0
財政	▲37,200	▲48,300	+3,000
過不足	▲37,300	▲47,900	+3,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
CP等買入	▲200		
国債補完供給	+36,700	▲33,100	+33,100
成長基盤強化支援			▲1,900
当座預金増減	▲33,900	▲16,700	+3,000
当座預金残高	5,351,500	5,334,800	5,337,800
準備預金残高	4,700,700		
積み終了先	4,699,600	国庫短期証券発行償還	
超過準備	4,699,400	(3M)	
非準備先残高	650,800	法人税・消費税・保険	
準備預金進捗率	99.9%	揚げ	
平均	58.6%		
乖離率	41.2%		

3月1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(3/1~3/4)	33,241	33,241	▲0.350	▲0.350		
	210	210	▲0.350	▲0.350		

マネタリーベース	所要
2月29日時点	3月4日以降の残り所要
6,645,600	3,772,800
	積数 5,300
	平均 400

国庫短期証券入札予定

3月7日	6ヶ月(第1217回)
3月8日	3ヶ月(第1218回)
3月15日	3ヶ月
3月18日	1年
3月5日	10年
3月7日	30年
3月12日	5年
3月14日	20年

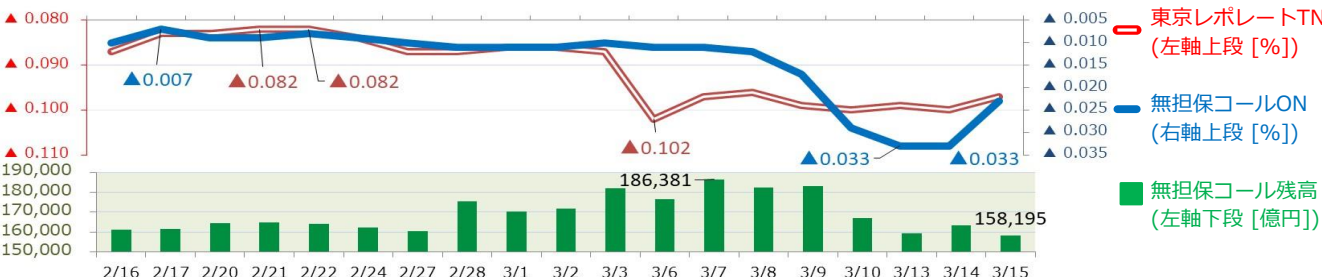
今月の国債買入オペ予定

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	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。