



短期市場の推移

	2月29日	3月1日	3月4日	3月5日
加重平均金利	▲0.005	▲0.005	▲0.006	▲0.007
東京レボレート(TN)	▲0.106	▲0.100	▲0.102	▲0.102
無コール残	166,759	176,559	173,931	181,631
ON	91,816	101,556	96,258	101,188
その他	74,943	75,003	77,673	80,443
有コール残	26,053	27,351	28,069	27,799

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	▲0.009	▲0.098
T/N	-	-	▲0.009	▲0.105
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.009	0.001	▲0.004	▲0.100
2W	-	-	0.025	▲0.100
3W	-	-	▲0.001	▲0.099
1M	-	-	0.030	▲0.097
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.040
6M	-	-	-	▲0.017
1Y	-	-	-	0.018

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7日の予定 (時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
14:00	消費活動指数 (1月)		(米) 貿易収支 (1月)	
	-		(欧) ラガルドECB総裁の会見	
	-			

本日の市況

無担保コールON物は▲0.005%の出合から始まり、その後は主に▲0.010%~▲0.004%を中心に取引された。引き続きビッドサイドの資金調達ニーズは底堅かったものの、オファーサイドの資金放出ニーズが強く、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比0.002%低下の▲0.009%となった。

	都銀・信託	証券	地銀
	- ~ -	- ~ -	▲0.010 ~ ▲0.004

翌営業日のマーケット

オファーサイドの資金放出ニーズの増加が見込まれるため、出合の水準は本日対比低下を予想する。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	3月6日	3月7日	3月7日	3月8日	3月8日	3月8日
券		+300		+0		+0
財政		▲27,600		+8,000		▲9,000
過不足		▲27,300		+8,000		▲9,000
金融調節	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド	スタート
国庫短期証券買入		+1,000				
共通担保(全店)	▲7,100	+8,300				
CP等買入	▲300		▲200			
社債等買入	▲200					
国債補充供給	+29,200	▲31,900	+31,900			
当座預金増減		▲28,300		+39,700		▲9,000
当座預金残高		5,283,900		5,323,600		5,314,600
準備預金残高		4,646,600				
積み終了先		4,646,200				
超過準備		4,646,000				
非準備先残高		637,300				
準備預金進捗率		99.9%				
平均		69.0%				
乖離率		30.9%				

3月6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(3/6~3/7)	32,130	32,130	▲0.350	▲0.350		
	27	27	▲0.350	▲0.350		

マナタリベース	所要
3月5日時点	6,571,500

所要	所要
今積期の所要準備額	3,772,800
3月7日以降の残り所要	
積数	2,500
平均	300

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

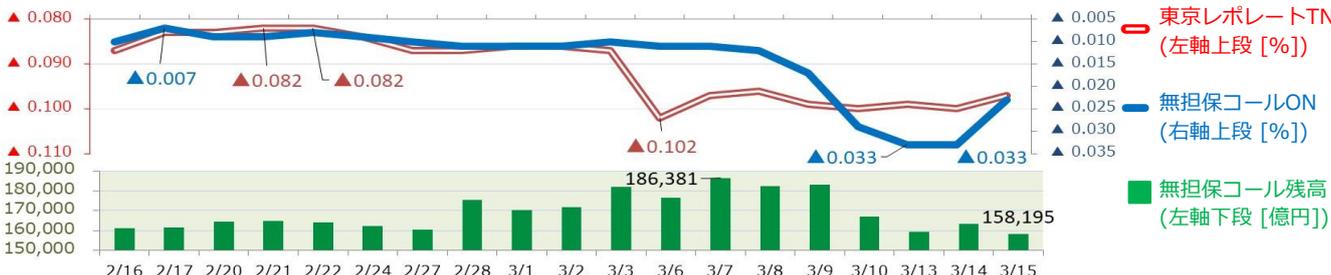
今月の国債買入オペ予定

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	3月4日	0
1年超3年以下	3,000~6,500	3,750	4 8 15 22	3月4日	3
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	3月4日	2
25年超	500~3,500	750	4 15	3月4日	1
物価連動債	600	600	月1回	2月28日	0
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。