上田八木短資

デイリーシグナル

2023年3月13日(月)

短期市場の推移 [億円] [%]

	3月7日	3月8日	3月9日	3月10日
加重平均金利	▲0.011	▲0.012	▲0.017	▲0.029
東京レポレート(TN)	▲0.097	▲0.096	▲0.099	▲0.100
無コール残	186,381	182,230	183,129	167,256
ON	99,263	100,662	102,581	89,988
その他	87,118	81,568	80,548	77,268
有コール残	30,760	31,491	30,477	30,053

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･有コール残は無担保･有担保コール残高の意。

3月14日の予定 (時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
	-		21:30	(米)2月消費者物価コア指数 [前年比]	5.4%
	-			-	
	-			-	

経済指標及び予想値は株式会社フィスコ提供

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	▲0.065	0.001	▲0.033	▲0.093
T/N	-	-	-	▲0.099
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	▲0.040	▲0.115
2W	▲0.020	0.008	▲0.006	▲0.128
3W	-	-	-	▲0.176
1M	-	-	0.010	▲0.179
2M	-	-	-	-
3M	0.025	0.040	0.028	▲0.154
6M	-	-	-	▲0.108
1Y	-	-	-	▲0.086

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

本日の市況

本日の無担保コールON物は▲0.035%の出合から始まり、その後は主に▲0.038%～ ▲0.025%の水準で取引された。ビッドサイドの調達意欲の低下もあり、ON物加重平均金利（速報）は前営業日対比▲0.004%の▲0.033%となった。

[%]

都銀・信託	証券	地銀
▲ 0.038 ～ ▲ 0.038	- ～ -	▲ 0.035 ～ ▲ 0.025

翌営業日のマーケット

引き続きビッドサイドの調達意欲は弱く、出合の水準は本日対比で若干の低下を予想。

資金需給 [億円]

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	3月13日		3月14日		3月15日	
券	+700		▲300		+0	
財政	+1,400		+3,400		▲26,000	
過不足	+2,100		+3,100		▲26,000	
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		
国債買入		+800				
CP等買入		+4,000	▲300			
国債補完供給	+52,200	▲53,200	+64,600			
当座預金増減	+5,900		+68,400		▲26,000	
当座預金残高	5,220,400		5,288,800		5,262,800	
準備預金残高	4,568,000		主な需給要因			
積み終了先	4,568,000		源泉税揚げ		国債発行（5年）	
超過準備	4,568,000				個人向け国債発行･償還	
非準預先残高	652,400					
準備預金進捗率	100.0%					
平均	92.9%					
乖離率	7.1%					

3月13日のオペ結果 [%][億円]※米ドル資金供給は百万$

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(3/14～)						
	1,000	1,600	1,000	0.004	0.004	
国債買入(固定利回り方式)(3/14～)						
5～10年	0	0				
5～10年	0	0				
5～10年	0	0				
国債補完供給(3/13～3/14)						
	13,940	13,940	▲1.100	▲3.451		
	39,022	39,022	▲0.350	▲0.350		
	0	0				
	419	419	▲0.350	▲0.352		

マネタリーベース [億円]

3月10日時点	6,483,300

所要 [億円]

今積期の所要準備額	3,515,000
3月14日以降の残り所要	
積数	0
平均	0

国庫短期証券入札予定

3月16日	1年 (第1145回)
3月17日	3ヶ月(第1146回)
3月24日	3ヶ月
4月3日	3ヶ月

国債入札予定

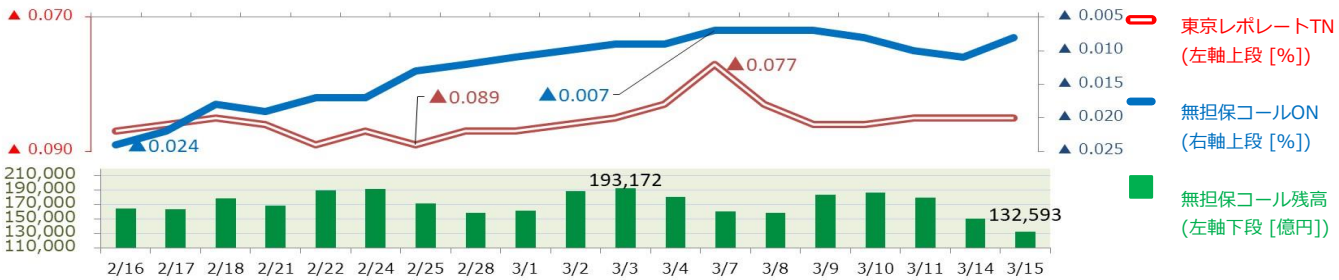
3月14日	5年
3月16日	20年
3月28日	40年
3月30日	2年

今月の国債買入オペ予定 [億円]

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3日	0
1年超3年以下	4,250～5,750	4,250	3	8	15	20			3月8日	2
3年超5年以下	5,000～6,500	5,000	3	8	15	29			3月8日	2
5年超10年以下	5,750～7,750	6,750	8	15	20	29			3月8日	3
10年超25年以下	2,000～4,000	3,000	3	8	20	29			3月8日	2
25年超	1,000～3,000	1,000	3	15	20				3月3日	2
物価連動債	600	600	月1回						2月27日	1
変動利付債<四半期>	300	300	四半期に1回						1月12日	-

1年前の市場推移 ○2022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。

上田八木短資株式会社 登録金融機関 近畿財務局長(登金)第 243号 加入協会 日本証券業協会