



短期市場の推移

	2月27日	2月28日	2月29日	3月1日
加重平均金利	▲0.006	▲0.006	▲0.005	▲0.005
東京レポレート(TN)	▲0.103	▲0.109	▲0.106	▲0.100
無コール残	177,073	182,131	166,759	176,559
ON	92,330	97,178	91,816	101,556
その他	84,743	84,953	74,943	75,003
有コール残	26,772	28,449	26,053	27,351

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。
 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	▲0.006	▲0.098
T/N	-	-	▲0.002	▲0.102
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.010	0.001	▲0.001	▲0.100
2W	-	-	0.000	▲0.102
3W	-	-	0.005	▲0.103
1M	-	-	0.170	▲0.102
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.052
6M	-	-	-	▲0.029
1Y	-	-	-	0.015

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5日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	(米) 2月のサービス業PMI (確報)	-
-	-	(米) 2月のISM非製造業指数	-
-	-	(欧) 2月のサービス業PMI (確報)	-

本日の市況

無担保コールON物は▲0.003%の出合から始まり、その後は主に▲0.009%~▲0.002%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く、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比0.001%低下の▲0.006%となった。

都銀・信託	証券	地銀
- ~ -	- ~ -	▲0.009 ~ ▲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	
	3月4日		3月5日		3月6日	
券	+400		+700		+0	
財政	▲47,400		▲1,300		▲30,000	
過不足	▲47,000		▲600		▲30,000	
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
国債買入				+7,400		
CP等買入				▲400		
国債補完供給	+33,100	▲31,000	+31,000			
成長基盤強化支援	▲1,900					
当座預金増減	▲46,800		+37,400		▲30,000	
当座預金残高	5,304,700		5,342,100		5,312,100	
準備預金残高	4,654,100		主な需給要因			
積み終了先	4,653,000		国債発行(10年)			
超過準備	4,653,000					
非準備先残高	650,600					
準備預金進捗率	99.9%					
平均	62.1%					
乖離率	37.8%					

3月4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
国債買入(3/5~)						
~1年	1,500	3,223	1,501	0.013	0.014	66.5
1~3年	3,750	14,239	3,752	▲0.001	0.001	88.6
10~25年	1,500	3,052	1,503	0.004	0.006	73.3
25年~	750	2,484	753	0.008	0.010	31.5
国債補完供給(3/4~3/5)						
	31,357	31,357	▲0.350	▲0.350		
	3	3	▲0.350	▲0.350		

マネタリーベース [億円]
 3月1日時点 6,612,000

所要	[億円]
今積期の所要準備額	3,772,800
3月5日以降の残り所要	
積数	4,200
平均	400

国債短期証券入札予定

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

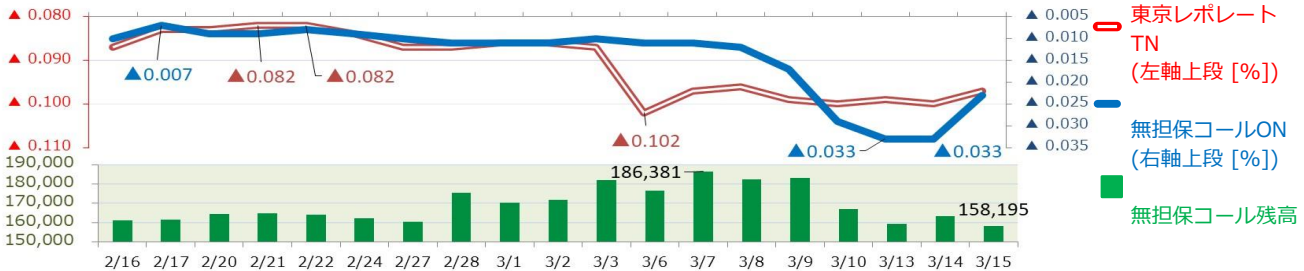
今月の国債買入オペ予定

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。 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