



短期市場の推移

	3月4日	3月5日	3月6日	3月7日
加重平均金利	▲0.006	▲0.007	▲0.009	▲0.011
東京レポレート(TN)	▲0.102	▲0.102	▲0.105	▲0.106
無コール残	173,931	181,631	184,820	188,127
ON	96,258	101,188	104,677	108,814
その他	77,673	80,443	80,143	79,313
有コール残	28,069	27,799	28,080	29,203

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	▲0.010	▲0.099
T/N	-	-	-	▲0.104
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.009	0.001	▲0.009	▲0.098
2W	-	-	-	▲0.096
3W	-	-	-	▲0.090
1M	-	-	-	▲0.083
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.022
6M	-	-	-	0.008
1Y	-	-	-	0.031

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11日の予定 (時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
8:50	10~12月の実質GDP (2次速報値)				

本日の市況

無担保コールON物は▲0.009%の出合から始まり、その後は主に▲0.010%~▲0.005%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%上昇の▲0.010%となった。

都銀・信託	証券	地銀
- ~ -	- ~ -	▲0.010 ~ ▲0.005

翌営業日のマーケット

オファーサイド・ビッドサイドの大きな動態変化はないと見込まれるため、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8日		3月11日		3月12日	
券	+600		+400		+0	
財政	+4,800		▲1,500		+2,000	
過不足	+5,400		▲1,100		+2,000	
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				+13,000		
CP等買入	▲500		▲100			+4,000
社債等買入	▲100					
国債補完供給	+29,800	▲29,800	+29,800			
当座預金増減	+4,800		+41,600		+6,000	
当座預金残高	5,301,900		5,343,500		5,349,500	
準備預金残高	4,647,800		主な需給要因			
積み終了先	4,647,300		国庫短期証券発行償還 (3M・6M)			
超過準備	4,647,300					
非準備先残高	654,100					
準備預金進捗率	99.9%					
平均	82.8%					
乖離率	17.1%					

3月8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(3/11~)						
1~3年	3,750	11,489	3,755	0.008	0.011	28.3
3~5年	4,250	9,927	4,256	0.007	0.010	83.4
5~10年	4,750	11,501	4,756	0.011	0.012	26.8
国債補完供給(3/8~3/11)						
	30,124	30,124	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マネタリーベース [億円]

3月7日時点 6,556,100

所要

今積期の所要準備額	3,772,700
3月11日以降の残り所要	
積数	500
平均	100

国庫短期証券入札予定

3月15日	3ヶ月(第1219回)
3月18日	1年
3月22日	3ヶ月
4月3日	3ヶ月

国債入札予定

3月12日	5年
3月14日	20年
3月27日	40年
3月29日	2年

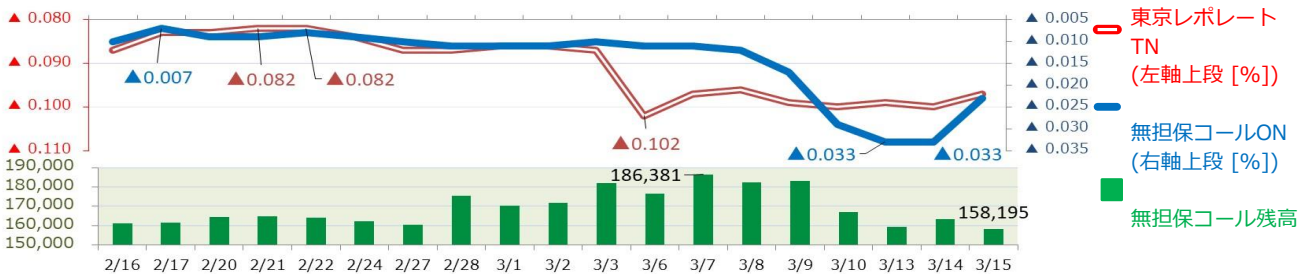
今月の国債買入オペ予定

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8日	2
3年超5年以下	3,500~7,500	4,250	8 15 22 28	3月8日	3
5年超10年以下	4,000~9,000	4,750	8 15 22 28	3月8日	3
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	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。 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