



短期市場の推移

	3月5日	3月6日	3月7日	3月8日
加重平均金利	▲0.007	▲0.009	▲0.011	▲0.010
東京レボレート(TN)	▲0.102	▲0.105	▲0.106	▲0.104
無コール残	181,631	184,820	188,127	185,777
ON	101,188	104,677	108,814	106,319
その他	80,443	80,143	79,313	79,458
有コール残	27,799	28,080	29,203	29,988

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	▲0.010	▲0.099
T/N	-	-	-	▲0.106
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.005	0.010	0.006	▲0.098
2W	-	-	-	▲0.094
3W	-	-	-	▲0.088
1M	-	-	0.300	▲0.082
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.021
6M	-	-	-	0.018
1Y	-	-	-	0.035

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12日の予定 (時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
8:50	企業物価指数 (2月)		(米) CPI (2月)	
	-			
	-			

本日の市況

無担保コールON物は▲0.008%の合出から始まり、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意欲は底堅く、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比横ばいの▲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、合出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11日	3月12日	3月12日	3月13日	3月13日	3月13日
券		+500		+100		+0
財政		▲300		+2,300		▲26,000
過不足		+200		+2,400		▲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
国債買入		+13,000				
CP等買入		▲100		+4,000		
国債補完供給		+29,800		+34,000		
当座預金増減		+8,900		+40,400		▲26,000
当座預金残高		5,310,800		5,351,200		5,325,200
準備預金残高		4,651,400	主な需給要因			
積み終了先		4,651,300				国債発行(5年)
超過準備		4,651,100				源泉税揚げ
非準備先残高		659,400				
準備預金進捗率		99.9%				
平均		86.2%				
乖離率		13.7%				

3月11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(3/11~3/12)	34,391	34,391	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マナタリーベース	【億円】
3月8日時点	6,560,300

所要	【億円】
今積期の所要準備額	3,772,700
3月12日以降の残り所要	
積数	200
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(第1220回)
3月22日	3ヶ月
4月3日	3ヶ月
3月12日	5年
3月14日	20年
3月27日	40年
3月29日	2年

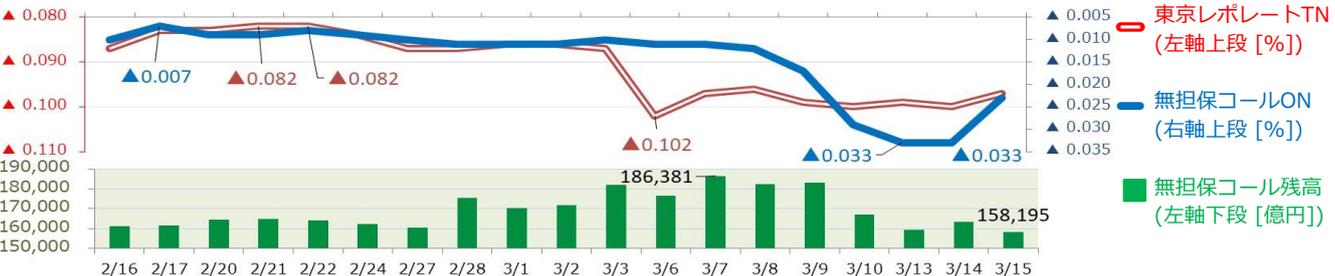
今月の国債買入オペ予定

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