



デイリーシグナル

2024年3月14日(木)

短期市場の推移

	3月8日	3月11日	3月12日	3月13日
加重平均金利	▲0.010	▲0.010	▲0.011	▲0.011
東京レポレート(TN)	▲0.104	▲0.106	▲0.115	▲0.110
無コール残	185,777	186,818	188,064	168,243
ON	106,319	106,070	107,521	90,650
その他	79,458	80,748	80,543	77,593
有コール残	29,988	28,569	28,331	28,625

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	▲0.009	▲0.098
T/N	-	-	▲0.001	▲0.088
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	▲0.005	▲0.069
2W	-	-	-	▲0.060
3W	-	-	-	▲0.055
1M	-	-	-	▲0.040
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	0.000
6M	-	-	-	0.030
1Y	-	-	-	0.057

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15日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	(米) 3月のNY連銀製造業指数	-
-	-	(米) 2月の鉱工業生産	-
-	-	-	-

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▲0.012%~▲0.006%を中心に取引された。積み終盤を迎え、最終調整の取り意欲も一部の見られON物加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.002%の▲0.009%となった。

都銀・信託	証券	地銀
- ~ -	- ~ -	▲0.012 ~ ▲0.006

翌営業日のマーケット

積み最終日ではあるが、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14日		3月15日		3月18日	
券	▲300		+900		+0	
財政	+8,000		+8,400		▲4,000	
過不足	+7,700		+9,300		▲4,000	
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
CP等買入	▲200	-	▲500	-	-	-
社債等買入	▲100	-	▲500	-	-	-
国債補完供給	+30,700	▲33,600	+33,600	-	-	-
貸出増加支援	-	-	-	-	▲41,500	+98,500
当座預金増減	+4,500		+41,900		+53,000	
当座預金残高	5,303,000		5,344,900		5,397,900	
準備預金残高	4,636,000		主な需給要因			
積み終了先	4,636,000		国債発行(5年・個人)		国庫短期証券発行償還(3M)	
超過準備	4,635,900		国債償還(個人)		-	
非準備先残高	667,000		-			
準備預金進捗率	100.0%		-			
平均	96.6%		-			
乖離率	3.4%		-			

3月14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(3/14~3/15)	33,954	33,954	▲0.350	▲0.350	-	-
	0	0	-	-	-	-

マネタリーベース (億円)
3月13日時点 6,555,700

所要	(億円)
今積期の所要準備額	3,772,700
3月15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

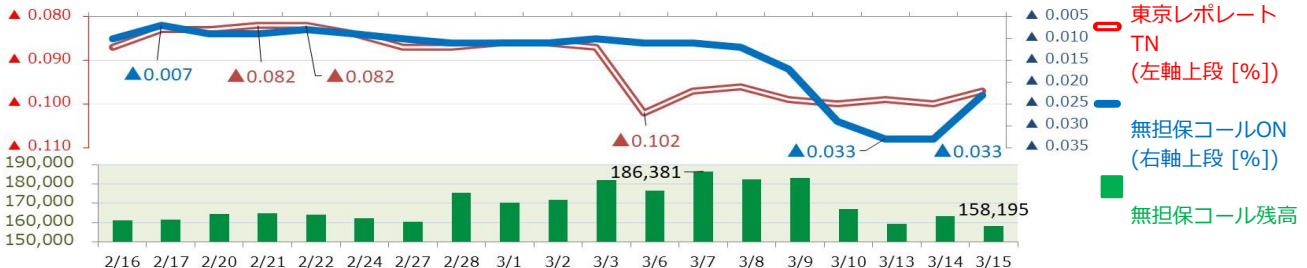
今月の国債買入オペ予定

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