



短期市場の推移

	3月11日	3月12日	3月13日	3月14日
加重平均金利	▲0.010	▲0.011	▲0.011	▲0.009
東京レボレート(TN)	▲0.106	▲0.115	▲0.110	▲0.088
無コール残	186,818	188,064	168,243	173,895
ON	106,070	107,521	90,650	98,952
その他	80,748	80,543	77,593	74,943
有コール残	28,569	28,331	28,625	28,492

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	▲0.005	▲0.086
T/N	-	-	0.001	▲0.061
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	-	▲0.045
2W	-	-	0.030	▲0.035
3W	-	-	-	▲0.027
1M	-	-	0.230	▲0.014
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	0.021
6M	-	-	-	0.043
1Y	-	-	-	0.070

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18日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
日銀金融政策決定会合 (1日目)		(欧) CPI (2月)	
-		-	
-		-	

本日の市況

無担保コールON物は▲0.003%の合出から始まり、その後は主に▲0.006%~▲0.001%を中心に取引された。取り手の資金調達ニーズは引き続き堅調であったものの、一部出し手が放出量を減少させたため、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.004%の▲0.005%となった。

都銀・信託	証券	地銀
- ~ -	- ~ -	▲0.006 ~ ▲0.001

翌営業日のマーケット

引き続き取り手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15日	3月18日	3月18日	3月19日	3月19日
券	+800	+400	+400	+0	+0
財政	+5,200	+10,900	+10,900	+14,000	+14,000
過不足	+6,000	+11,300	+11,300	+14,000	+14,000
金融調節	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド
国債買入			+13,400		
共通担保(全店)					▲8,300
CP等買入	▲500				
社債等買入	▲500		▲100		
国債補充供給	+33,600	▲32,100	+32,100		
貸出増加支援			▲45,900	+98,500	
当座預金増減		+6,500	+109,300	+5,700	
当座預金残高		5,309,600	5,418,900	5,424,600	
準備預金残高		4,636,200			主な需給要因
積み終了先		4,636,200	国庫短期証券発行償還		
超過準備		4,636,200	(3M)		
非準備先残高		673,400			
準備預金進捗率		100.0%			
平均		100.0%			
乖離率		0.0%			

3月15日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
国債買入(3/18~)						
1~3年	3,750	7,565	3,752	0.003	0.008	24.6
3~5年	4,250	8,869	4,252	0.018	0.019	68.1
5~10年	4,750	8,079	4,755	0.017	0.020	58.5
25年~	750	2,777	754	0.052	0.053	99.2
社債等買入(3/21~)						
1,000	1,545	1,000	0.273	0.303	26.6	
国債補充供給(3/15~3/18)						
32,589	32,589	▲0.350	▲0.352			
0	0					

マネタリーベース (億円)
3月14日時点 6,560,600

所要	(億円)
来積期の所要準備額	4,047,500
3月18日以降の残り所要	
積数	128,200
平均	4,400

国庫短期証券入札予定

3月18日	1年 (第1220回)
3月22日	3ヶ月 (第1221回)
4月3日	3ヶ月
4月5日	3ヶ月
国債入札予定	
3月27日	40年
3月29日	2年
4月2日	10年
4月4日	30年

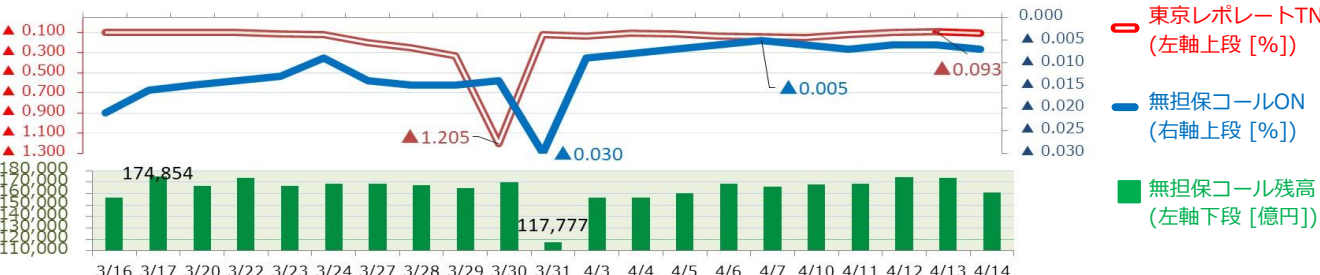
今月の国債買入オペ予定

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15日	1
3年超5年以下	3,500~7,500	4,250	8 15 22 28	3月15日	2
5年超10年以下	4,000~9,000	4,750	8 15 22 28	3月15日	2
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15日	0
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3月積み期 [3月16日~4月14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