



短期市場の推移

	3月14日	3月15日	3月18日	3月19日
加重平均金利	▲0.009	▲0.005	▲0.003	▲0.001
東京レボレート(TN)	▲0.088	▲0.061	▲0.083	▲0.045
無コール残	173,895	136,502	129,991	163,636
ON	98,952	80,169	78,228	115,523
その他	74,943	56,333	51,763	48,113
有コール残	28,492	27,610	28,281	26,694

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	0.040	0.130	0.074	▲0.101
T/N	-	-	-	0.029
S/N	-	-	-	-
1W	0.130	0.160	0.143	0.012
2W	-	-	0.190	▲0.016
3W	-	-	-	0.004
1M	0.120	0.580	0.157	0.019
2M	-	-	-	-
3M	-	-	0.150	0.044
6M	-	-	-	0.074
1Y	-	-	-	0.104

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22日の予定 (時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
8:30	CPI (2月)		(米)パウエルFRB議長 あいさつ	
	-			
	-			

本日の市況

無担保コールON物は0.075%の出合から始まり、その後は主に0.070%~0.077%を中心に取引された。本日より日銀当座預金の超過準備に0.10%の付利が適用された。付利金利との裁定を意識したレートに収束し、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.075%の0.074%となった。

	都銀・信託	証券	地銀
	- ~ -	0.075 ~ 0.075	0.070 ~ 0.077

翌営業日のマーケット

ビットサイドの資金調達意欲は引き続き旺盛であり、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21日	3月22日	3月22日	3月25日	3月25日	3月25日
券	▲400	+200	+200	+1,000	+1,000	
財政	+75,800	▲800	▲800	+43,000	+43,000	
過不足	+75,400	▲600	▲600	+44,000	+44,000	
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
国債買現先	▲28,500		▲300			
CP等買入	▲100					
社債等買入	+1,000					
国債補充供給	+42,600	▲57,200	+57,200			
当座預金増減	+33,200	+56,300	+56,300	+44,000	+44,000	
当座預金残高	5,468,000	5,524,300	5,524,300	5,568,300	5,568,300	
準備預金残高	4,796,400					主な需給要因
積み終了先	4,784,300		流動性供給			国庫短期証券発行償還
超過準備	4,778,800					(3M)
非準備先残高	671,600					各種財政資金の支払い
準備預金進捗率	99.4%					
平均	19.4%					
乖離率	80.0%					

3月21日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
国債補充供給(3/21~3/22)	57,651	57,651	▲0.250	▲0.250		
	0	0				

マネタリーベース	所要
3月19日時点	6,691,600
今積期の所要準備額	4,047,500
3月22日以降の残り所要	
積数	24,800
平均	1,000

国庫短期証券入札予定

3月22日	3ヶ月(第1221回)
4月3日	3ヶ月
4月5日	3ヶ月
4月9日	6ヶ月

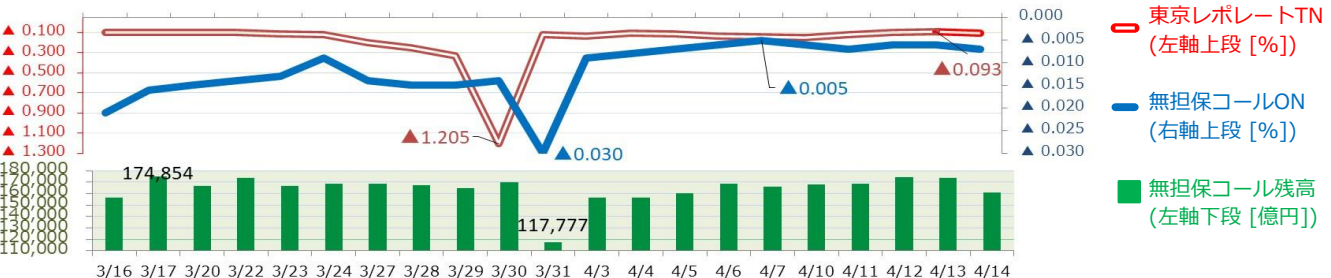
今月の国債買入オペ予定

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