



短期市場の推移

	3月18日	3月19日	3月21日	3月22日
加重平均金利	▲0.003	▲0.001	0.074	0.077
東京レボレート(TN)	▲0.083	▲0.045	0.029	0.004
無コール残	129,991	163,636	94,535	92,690
ON	78,228	115,523	51,372	51,657
その他	51,763	48,113	43,163	41,033
有コール残	28,281	26,694	29,586	32,152

3月26日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
		(米) 消費者信頼感指数 (3月)	

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	0.050	0.078	0.077	0.007
T/N	-	-	-	0.000
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	0.100	▲0.040
2W	-	-	0.180	▲0.023
3W	-	-	-	▲0.007
1M	-	-	-	0.004
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	0.042
6M	-	-	-	0.074
1Y	-	-	-	0.103

本日の市況

無担保コールON物は0.077%の出合から始まり、その後は主に0.076%~0.078%を中心に取引された。ビットサイドの資金調達意欲は強く、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比横ばいの0.077%となった。

都銀・信託	証券	地銀
- ~ -	- ~ -	0.076 ~ 0.078

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。

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

資金需給	日銀速報			日銀予想			当社需給予想	
	3月25日	3月26日	3月27日	3月25日	3月26日	3月27日	3月27日	3月27日
券		+400	+100		+100	+0		+0
財政		+51,100	+23,600		+23,600	+6,000		+6,000
過不足		+51,500	+23,700		+23,700	+6,000		+6,000
金融調節	エンド	スタート	エンド	スタート	スタート	エンド	スタート	スタート
国債買入		+14,100						
CP等買入	▲400		▲600					
国債補完供給	+50,100	▲43,700	+43,700					
当座預金増減		+71,600	+66,800		+66,800	+6,000		+6,000
当座預金残高		5,538,200	5,605,000		5,605,000	5,611,000		5,611,000
準備預金残高		4,875,500						
積み終了先		4,873,900						
超過準備		4,872,600						
非準備先残高		662,700						
準備預金進捗率		99.8%						
平均		32.3%						
乖離率		67.6%						

3月25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
国債補完供給(3/25~3/26)	44,208	44,208	▲0.250	▲0.250		
	0	0				

マナタリーベース	所要
3月22日時点	6,723,700
今積期の所要準備額	4,047,500
3月26日以降の残り所要	
積数	6,100
平均	300

国庫短期証券入札予定

4月3日	3ヶ月
4月5日	3ヶ月
4月9日	6ヶ月
4月12日	3ヶ月
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22日	0
3年超5年以下	3,500~7,500	4,250	8 15 22 28	3月22日	1
5年超10年以下	4,000~9,000	4,750	8 15 22 28	3月22日	1
10年超25年以下	1,000~5,000	1,500	4 22 28	3月22日	1
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