



短期市場の推移

	3月19日	3月21日	3月22日	3月25日
加重平均金利	▲0.001	0.074	0.077	0.077
東京レポレート(TN)	▲0.045	0.029	0.004	0.000
無コール残	163,636	94,535	92,690	95,496
ON	115,523	51,372	51,657	54,463
その他	48,113	43,163	41,033	41,033
有コール残	26,694	29,586	32,152	30,782

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	0.055	0.078	0.077	0.028
T/N	-	-	-	0.025
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	-	▲0.013
2W	-	-	-	▲0.002
3W	-	-	-	0.007
1M	-	-	-	0.019
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	0.043
6M	-	-	-	0.074
1Y	-	-	-	0.103

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27日の予定 (時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
	-			-	
	-			-	
	-			-	

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0.075%~0.078%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
- ~ -	- ~ -	0.075 ~ 0.078

翌営業日のマーケット

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26日		3月27日		3月28日	
券	+100		▲200		▲1,000	
財政	+20,800		+21,500		▲6,600	
過不足	+20,900		+21,300		▲7,600	
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	▲600		▲300			
国債補充供給	+43,700	▲36,900	+36,900			
当座預金増減	+27,100		+57,900		▲7,600	
当座預金残高	5,565,300		5,623,200		5,615,600	
準備預金残高	4,911,900		主な需給要因			
積み終了先	4,910,400		国債発行(40年)			
超過準備	4,910,300					
非準備先残高	653,400					
準備預金進捗率	99.9%					
平均	35.5%					
乖離率	64.4%					

3月26日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
米ドル資金供給(3/28~4/4)	0	0	5.580	5.580		
CP等買入(3/29~)	4,000	5,845	3,996	0.080	0.124	3.7
国債補充供給(3/26~3/27)	37,313	37,313	▲0.250	▲0.250		
	40	40	▲0.250	▲0.250		

マネタリーベース	3月25日時点
(億円)	6,794,900

所要	今積期の所要準備額	3月27日以降の残り所要
(億円)	4,047,500	
積数	4,500	
平均	200	

国債短期証券入札予定

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

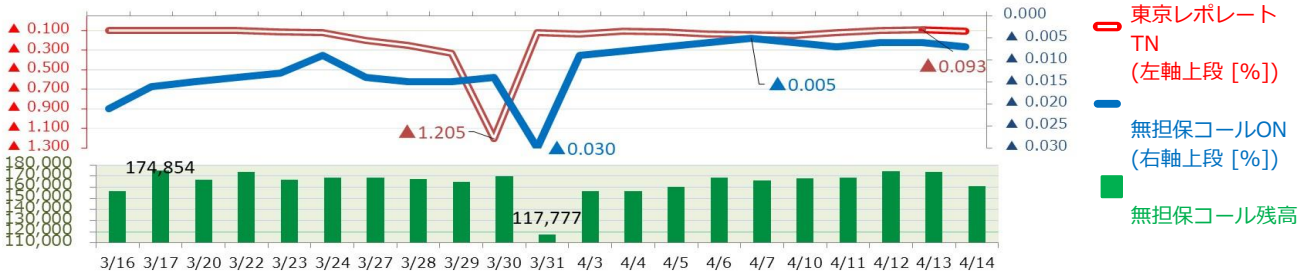
今月の国債買入オペ予定

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