



短期市場の推移

	3月21日	3月22日	3月25日	3月26日
加重平均金利	0.074	0.077	0.077	0.077
東京レボレート(TN)	0.029	0.004	0.000	0.025
無コール残	94,535	92,690	95,496	91,145
ON	51,372	51,657	54,463	50,372
その他	43,163	41,033	41,033	40,773
有コール残	29,586	32,152	30,782	33,809

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	0.055	0.078	0.077	0.006
T/N	-	-	-	0.010
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	-	▲0.017
2W	-	-	-	0.003
3W	-	-	-	0.011
1M	-	-	0.150	0.022
2M	-	-	-	-
3M	0.155	0.280	0.235	0.043
6M	-	-	-	0.074
1Y	-	-	-	0.103

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28日の予定 (時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
8:50	金融政策決定会合における主な意見(3月18~19日)		(米)実質GDP(10~12月) (3次速報)	
	-		-	
	-		-	

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意欲は底堅く、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27日	3月28日	3月29日
券	▲200	▲100	+400
財政	+15,100	+8,900	+38,600
過不足	+14,900	+8,800	+39,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
CP等買入	▲300	▲300	
国債補完供給	+36,900	▲36,200	+36,200
当座預金増減	+15,300	+44,700	+43,000
当座預金残高	5,580,600	5,625,300	5,668,300
準備預金残高	4,923,600	主な需給要因	
積み終了先	4,922,100	国債発行(40年)	
超過準備	4,922,100	各種財政資金の支払い	
非準備先残高	657,000		
準備預金進捗率	99.9%		
平均	38.7%		
乖離率	61.2%		

3月27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(3/27~3/28)	36,626	36,626	▲0.250	▲0.250		
	0	0				

マネタリーベース (億円)
3月26日時点 6,821,900

所要	(億円)
今積期の所要準備額	4,047,500
3月28日以降の残り所要	
積数	2,900
平均	200

国庫短期証券入札予定

4月3日	3ヶ月(第1222回)
4月5日	3ヶ月
4月9日	6ヶ月
4月12日	3ヶ月

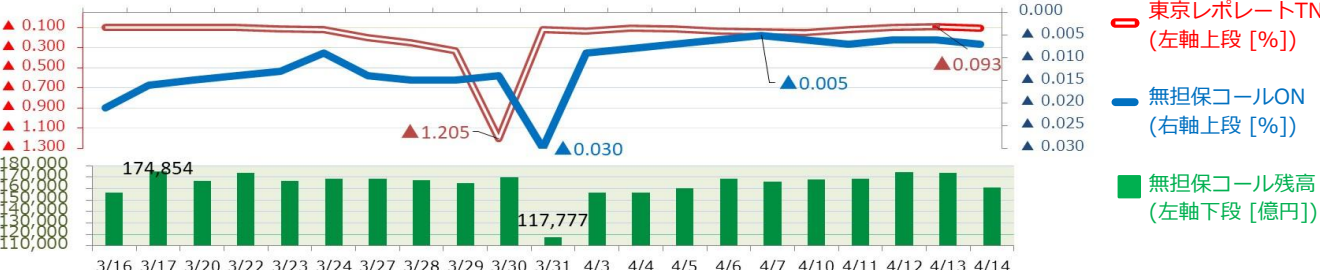
今月の国債買入オペ予定

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。