## 上田八木短資



## デイリーシグナル

2022年3月15日(火)

短其	明市場の推	移			[億円] [%]
		3月9日	3月10日	3月11日	3月14日
	巨平均金利	▲0.007	▲0.008	▲0.010	▲0.011
	東京レボ — ト(TN)	▲0.086	▲0.086	▲0.085	▲0.085
無	コール残	183,964	186,585	180,137	150,735
	ON	104,831	101,432	101,149	79,172
	その他	79,133	85,153	78,988	71,563
有	コール残	28,386	28,567	29,081	29,040

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

3月16日の予定 (時刻は日本時間)

	日本	予想		海外	予想
8:50	2月貿易収支	-210億円	21:30	(米)2月小売売上高	0.4%
	-		23:00	(米)1月企業在庫	1.1%
	-			-	

経済指標及び予想値は株式会社フィスコ提供

	7001403 0038	m 13 -	TO A SIMON AS IN A SINON	7 D / JG 10 J D / JG 10
本日の短期市場金利				[%]

	無技	旦保コール(速	報)	レポ市場
	最低	最高	平均	東京レポ
				レート
O/N	▲0.055	0.001	▲0.008	▲0.088
T/N	1	ı	▲0.010	▲0.085
S/N	-	1	▲0.005	ı
1W	▲0.020	▲0.001	▲0.007	▲0.085
2W	▲0.040	▲0.037	▲0.038	▲0.087
3W	-	1	-	▲0.097
1M	▲0.009	0.010	0.000	▲0.099
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.101
6M	-	1	-	▲0.104
1Y	-	-	-	▲0.112

本日の市況

無担保コールON物は▲0.010%の出合から始まり、その後は主に▲0.010%~▲0.001%のレンジで 推移した。着地を見据えたビッドサイドの調達需要の強まりから、同加重平均金利(速報)は前営 業日対比+0.003%の▲0.008%(速報)となった。

都銀・信託	証券	地銀
<b>▲</b> 0.015 ~ <b>▲</b> 0.010	<b>▲</b> 0.010 ~ <b>▲</b> 0.004	<b>▲</b> 0.015 ~ <b>▲</b> 0.001

翌営業日のマーケット

新積み期に入り、運用ニーズの高まりが想定され、出合いの水準は本日比で低下すると予想。

無担保コール(連報)け日銀 東京レポレートけ日本証券業協会公表

無担保コール(体報)は日朝	*、 米ホレハレ	一下は日本証が	プ 未励 云 ム 衣			
資金需給						[億円]
	日銀	速報	日銀	予想	当社需	給予想
	3月:	15日	3月:	16日	3月	17日
券		+300		<b>▲</b> 600		<b>▲</b> 1,000
財政		+2,900		▲3,400		+3,000
過不足		+3,200		<b>▲</b> 4,000		+2,000
金融調節	ドンド	スタート	エンド	スタート	エンド	スタート
国庫短期証券買入				+10,000	/	
国債買現先			<b>▲</b> 40,700			
共通担保(全店)			<b>▲</b> 2,600	+4,300		
CP等買入	▲800		<b>▲</b> 100	+5,000		
国債補完供給	+100					
貸出増加支援			▲22,500	+38,900		

	+3,000		▲3,400		+2,900	
_	+2,000		<b>▲</b> 4,000		+3,200	
ţ	スタート	エンド	スタート	エンド	スタート	ンド
		/	+10,000			
[3				<b>▲</b> 40,700		
			+4,300	▲2,600		
			+5,000	<b>▲</b> 100		▲800
						+100
			+38,900	▲22,500		

	当座預金増減	+2,5	500	<b>▲</b> 11,700	+2,000
	当座預金残高	5,327,5	500	5,315,800	5,317,800
	準備預金残高	4,685,8	300	主な需	給要因
	積み終了先	4,685,8	300	流動性供給	
	超過準備	4,685,8	300		
L	非準預先残高	641,7	700		
	準備預金進捗率	100.0	0%		
	平均	100.0	0%		
U	乖離率	0.0	%0		

3月15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(3/15~3/16)

0 0 0

共通担保(全店)(3/16~3/30)

20,000 4,251 4,251 国庫短期証券買入(3/16~)

10,000 37,607 10,000 0.006 0.006

マネタリーベ-	-ス [億円]
3月14日時点	6,569,300

所要		[億円]
	来積期の所要準備額	3,775,500
	3月16日以降の残り所要	
	積数	3,775,500
	平均	121,800

<u> 国津知期証券人</u>	(札予正
3月16日	1年 (第1066回)
3月17日	3ヶ月(第1067回)
3月24日	6ヶ月
3月25日	3ヶ月
国債入札予定	
3月29日	40年
3月31日	2年
2月1日	10年

30年

=h=to=+#117=

2月3日

オペ種類
1年超3年以下 4500 4,500 2 9 16 23 3月9日 2   3年超5年以下 4500 4,500 2 9 23 30 3月2日 2
3年超5年以下 4500 4,500 //2/ ///9/ 23 30 ///// 3月2日 2
5年初10年以下 4250 4250 0 16 22 20 2月0日 2
3年起10年以下 4230 4,230 ////////////////////////////////////
10年超25年以下 1500 1,500 2 3月2日 0
25年超 500 500 16 2月16日 1
物価連動債 600 600 月1回 2月24日 1
変動利付債<四半期> 300 300 四半期に1回 1月20日 -

1年前の市場推移 ○2021年3月積み期 [3月16日~4月15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。



3/16 3/17 3/18 3/19 3/22 3/23 3/24 3/25 3/26 3/29 3/30 3/31 4/1 4/2 4/5 4/6 4/7 4/8 4/9 4/12 4/13 4/14 4/15

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