



デイリーシグナル

2022年3月31日(木)

短期市場の推移

	3月25日	3月28日	3月29日	3月30日
加重平均金利	▲0.004	▲0.004	▲0.004	▲0.004
東京レボレート(TN)	▲0.088	▲0.091	▲0.103	▲0.300
無コール残	203,577	187,893	189,313	193,389
ON	106,164	90,945	97,325	112,416
その他	97,413	96,948	91,988	80,973
有コール残	30,127	29,440	30,442	29,517

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	▲0.080	0.001	▲0.020	▲0.264
T/N	-	-	▲0.200	▲0.126
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	0.001	▲0.111
2W	▲0.040	▲0.001	▲0.021	▲0.109
3W	-	-	-	▲0.107
1M	-	-	-	▲0.107
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.102
6M	-	-	-	▲0.103
1Y	-	-	-	▲0.108

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

4月1日の予定 (時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
8:50	1-3月期日銀短観(大企業製造業DI)	12	18:00	(欧)3月消費者物価コア指数 [前年比]	-
	-		21:30	(米)3月失業率	3.7%
	-		23:00	(米)3月ISM製造業景況指数	58.3

経済指標及び予想値は株式会社フィスコ提供

本日の市況

無担保コールON物は▲0.020%の出合から始まり、その後は主に▲0.020%~▲0.005%の水準で取引された。ビッドサイドの一部では年度末初の取引を控える先もあり、同加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.016%の▲0.020%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.030 ~ ▲0.030	▲0.020 ~ ▲0.020	▲0.020 ~ ▲0.001

翌営業日のマーケット

年度末で取引を控えていたビッドサイドが調達を再開し、出合水準は3/30と同程度まで上昇すると予想。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	3月31日	4月1日	4月1日	4月4日	4月4日	4月4日
券	+100	▲300	▲300	▲1,100	▲1,100	▲1,100
財政	+45,000	▲31,900	▲31,900	▲7,000	▲7,000	▲7,000
過不足	+45,100	▲32,200	▲32,200	▲8,100	▲8,100	▲8,100
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
国債買入		+23,100				
CP等買入	▲9,000	+5,000				
E T F 買入				+600		
国債補充供給	+300	▲9,200	+9,200			
当座預金増減	+55,300	▲22,400	▲22,400	▲8,100	▲8,100	▲8,100
当座預金残高	5,631,800	5,609,400	5,609,400	5,601,300	5,601,300	5,601,300
準備預金残高	5,006,500					
積み終了先	5,006,500	国債発行・償還(2年)	消費税・法人税・保険			
超過準備	5,003,400			揚		
非準備先残高	625,300			普通交付税		
準備預金進捗率	99.9%			国庫短期証券発行・償還(3M)		
平均	51.6%					
乖離率	48.3%					

3月31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(3/31~4/1)	9,077	9,077	▲0.550	▲0.582		
	87	87	▲0.550	▲0.550		

マネタリーベース (億円)
 3月30日時点 6,825,200

所要	(億円)
今積期の所要準備額	3,775,500
4月1日以降の残り所要	
積数	200
平均	0

国庫短期証券入札予定

2月4日	3ヶ月
2月9日	6ヶ月
2月10日	3ヶ月
2月17日	1年
2月1日	10年
2月3日	30年
2月8日	物価連動
2月15日	5年

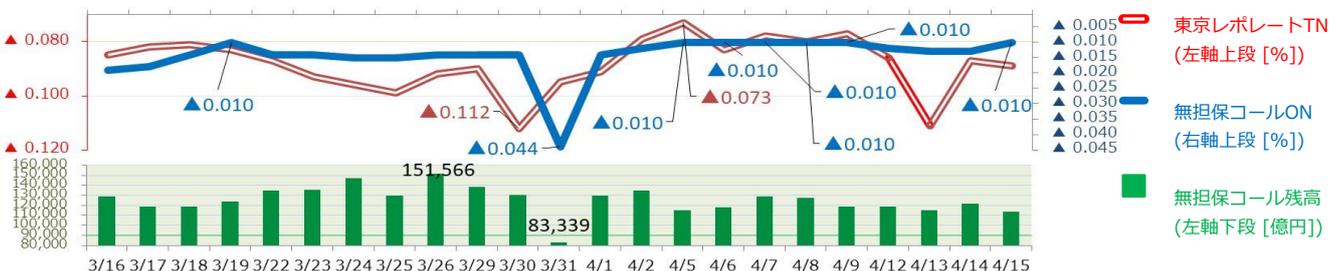
来月の国債買入オペ予定

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2日	1
1年超3年以下	4750	4,500	4 8 13 20	3月23日	4
3年超5年以下	4750	6,000	4 8 20 26	3月30日	4
5年超10年以下	5000	5,000	8 13 20 26	3月30日	4
10年超25年以下	1250	1,000	4 20	3月30日	2
25年超	500	500	13 26	3月30日	2
物価連動債	600	600	月1回	3月30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。



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