



短期市場の推移

	2月24日	2月27日	2月28日	3月1日
加重平均金利	▲0.009	▲0.010	▲0.011	▲0.011
東京レボレート(TN)	▲0.084	▲0.087	▲0.087	▲0.086
無コール残	162,299	160,383	175,490	170,381
ON	83,531	85,795	100,752	91,793
その他	78,768	74,588	74,738	78,588
有コール残	28,830	29,103	27,466	30,286

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	▲0.057	0.001	▲0.011	▲0.085
T/N	-	-	▲0.010	▲0.086
S/N	-	-	▲0.008	-
1W	-	-	-	▲0.097
2W	▲0.025	▲0.009	▲0.020	▲0.104
3W	-	-	▲0.001	▲0.115
1M	-	-	▲0.018	▲0.147
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.146
6M	-	-	-	▲0.106
1Y	-	-	-	▲0.083

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3日の予定 (時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
8:30	1月有効求人倍率	1.36倍	19:00	(欧)1月生産者物価指数[前年比]	-
8:30	1月失業率	+2.5%			

本日の市況

本日の無担保コールON物は▲0.010%の合出から始まり、その後は主に▲0.015%~▲0.008%の水準で取引された。オファービッド動向に大きな変化はなく、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比横ばいの▲0.011%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.015 ~ ▲0.010	- ~ -	▲0.014 ~ ▲0.008

翌営業日のマーケット

週末3日積みとなるものの、ビッドサイド動向に大きな変化はなく、出合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2日	3月3日	3月3日	3月6日	3月6日
券	▲700	+100			▲1,000
財政	▲44,700	▲30,200			▲4,000
過不足	▲45,400	▲30,100			▲5,000
金融調節	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド
国債買入			+17,700		
CP等買入	▲100		▲200		
社債等買入			▲800		
国債補充供給	+51,700	▲56,500	+61,900		
成長基盤強化支援			▲2,500		
当座預金増減	▲50,300	+46,000			▲5,000
当座預金残高	5,185,200	5,231,200			5,226,200
準備預金残高	4,534,100				
積み終了先	4,533,800				
超過準備	4,533,500				
非準備預金残高	651,100				
準備預金進捗率	99.9%				
平均	53.6%				
乖離率	46.3%				

3月2日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
国債買入(固定利回り方式)(3/3~)						
5~10年	17,698	17,698				
5~10年	0	0				
5~10年	0	0				
国債補充供給(3/2~3/3)						
19,439	18,854	▲1.100	▲3.423			
37,410	37,410	▲0.350	▲0.351			
150	150	▲0.350	▲0.350			
485	485	▲3.000	▲3.000			

マナタリーベース	所要
3月1日時点	6,505,300
今積期の所要準備額	3,518,100
3月3日以降の残り所要	
積数	1,500
平均	100

国庫短期証券入札予定

3月3日	3ヶ月(第1142回)
3月8日	6ヶ月(第1143回)
3月9日	3ヶ月(第1144回)
3月16日	1年
3月7日	30年
3月14日	5年
3月16日	20年
3月28日	40年

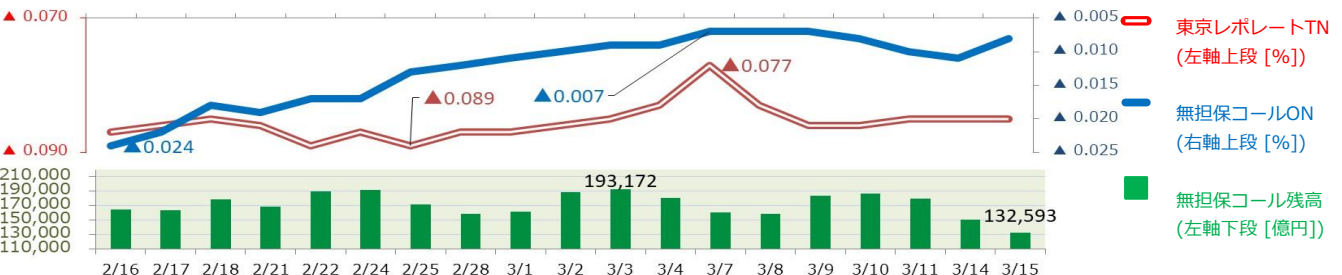
今月の国債買入オペ予定

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	2月3日	1
1年超3年以下	4,250~5,750	4,250	3 8 15 20	2月20日	4
3年超5年以下	5,000~6,500	5,000	3 8 15 29	2月27日	4
5年超10年以下	5,750~7,750	6,750	8 15 20 29	2月27日	4
10年超25年以下	2,000~4,000	3,000	3 8 20 29	2月27日	4
25年超	1,000~3,000	1,500	3 15 20	2月27日	3
物価連動債	600	600	月1回	2月27日	1
変動利付債<四半期>	300	300	四半期に1回	1月12日	-

1年前の市場推移

○2022年2月積み期 [2月16日~3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