



短期市場の推移

	2月27日	2月28日	3月1日	3月2日
加重平均金利	▲0.010	▲0.011	▲0.011	▲0.011
東京レポレート(TN)	▲0.087	▲0.087	▲0.086	▲0.086
無コール残	160,383	175,490	170,381	171,829
ON	85,795	100,752	91,793	87,081
その他	74,588	74,738	78,588	84,748
有コール残	29,103	27,466	30,286	29,220

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)			レポ市場
	最低	最高	平均	東京レポレート
O/N	▲0.056	0.001	▲0.010	▲0.086
T/N	-	-	▲0.010	▲0.087
S/N	-	-	▲0.008	-
1W	-	-	-	▲0.098
2W	▲0.010	▲0.008	▲0.009	▲0.105
3W	-	-	-	▲0.117
1M	-	-	-	▲0.147
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.146
6M	-	-	-	▲0.106
1Y	-	-	-	▲0.083

無担保コール(速報)は日銀、東京レポレートは日本証券業協会公表

3月6日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	-	-
-	-	-	-
-	-	-	-

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

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%~▲0.005%の水準で取引された。オファー・ビッドの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+0.001の▲0.010%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.010 ~ ▲0.010	- ~ -	▲0.013 ~ ▲0.005

翌営業日のマーケット

オファー・ビッドの動向に大きな変化はなく、出合の水準は本日対比横ばい圏と予想。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	3月3日	3月6日	3月6日	3月7日	3月7日	3月7日
債券	+200	+300	+300	+1,000		
財政	▲30,700	▲3,000	▲3,000	+5,000		
過不足	▲30,500	▲2,700	▲2,700	+6,000		
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		+17,700		+17,700		
CP等買入	▲200		▲200			
社債等買入	▲800					
国債補完供給	+51,200		+61,800			
成長基盤強化支援	▲2,500					
当座預金増減	▲17,200	+76,600	+76,600	+6,000		
当座預金残高	5,168,000	5,244,600	5,244,600	5,250,600		
準備預金残高	4,515,700					
積み終了先	4,515,500					
超過準備	4,515,400					
非準備先残高	652,300					
準備預金進捗率	99.9%					
平均	64.3%					
乖離率	35.6%					

3月3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)(3/6~)						
5~10年	2,776	2,776				
5~10年	0	0				
5~10年	0	0				
国債買入(3/6~)						
~1年	1,500	3,380	1,501	▲0.015	▲0.001	16.6
1~3年	4,250	9,482	4,254	▲0.003	▲0.002	82.1
3~5年	5,000	10,487	5,003	▲0.004	▲0.003	48.2
10~25年	3,000	5,883	3,011	0.002	0.005	9.7
25年~	1,000	3,017	1,010	0.013	0.015	6.0
国債補完供給(3/3~3/6)						
	18,242	16,681	▲1,100	▲3.540		
	35,778	35,778	▲0.350	▲0.350		
	11	11	▲0.350	▲0.350		

マネタリーベース (億円)
3月2日時点 6,455,700

所要 (億円)
今積期の所要準備額 3,518,100
3月6日以降の残り所要積数 800
平均 100

国庫短期証券入札予定

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17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3日	0
1年超3年以下	4,250~5,750	4,250	3 8 15 20	3月3日	3
3年超5年以下	5,000~6,500	5,000	3 8 15 29	3月3日	3
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	3月3日	3
25年超	1,000~3,000	1,000	3 15 20	3月3日	2
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