



短期市場の推移

	2月28日	3月1日	3月2日	3月3日
加重平均金利	▲0.011	▲0.011	▲0.011	▲0.010
東京レボレート(TN)	▲0.087	▲0.086	▲0.086	▲0.087
無コール残	175,490	170,381	171,829	182,042
ON	100,752	91,793	87,081	95,284
その他	74,738	78,588	84,748	86,758
有コール残	27,466	30,286	29,220	29,801

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	▲0.060	0.001	▲0.011	▲0.092
T/N	-	-	▲0.010	▲0.102
S/N	-	-	▲0.008	-
1W	▲0.040	▲0.009	▲0.034	▲0.108
2W	-	-	-	▲0.116
3W	-	-	0.001	▲0.130
1M	-	-	-	▲0.154
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.150
6M	-	-	-	▲0.108
1Y	-	-	-	▲0.084

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7日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
15:00	2月コール市場残高	(米) パウエル議長 議会証言 (上院)	
	-	-	-
	-	-	-

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%の割合から始まり、その後は主に▲0.015%~ ▲0.008%の水準で取引された。前営業日と比べ、一部ビッドサイドの調達姿勢が弱含んだため、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.001%の▲0.011%となった。

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

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いの水準は横ばいと予想する。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想
	3月6日	3月7日	3月7日	3月8日	3月8日
券	+300	+400	+400	+0	+0
財政	▲300	+3,700	+3,700	▲4,000	▲4,000
過不足	+0	+4,100	+4,100	▲4,000	▲4,000
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	+2,700		
共通担保(全店)				▲4,300	
CP等買入	▲200		▲100		
国債補充供給	+49,500	▲50,000	+61,900		
当座預金増減	+17,000	+68,600	+68,600	▲8,300	▲8,300
当座預金残高	5,185,000	5,253,600	5,253,600	5,245,300	5,245,300
準備預金残高	4,521,000				
積み終了先	4,520,800				
超過準備	4,520,800				
非準備預金残高	664,000				
準備預金進捗率	99.9%				
平均	67.9%				
乖離率	32.0%				

3月6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
国債買入(固定利回り方式)(3/7~)						
5~10年	2,650	2,650				
5~10年	0	0				
5~10年	0	0				
国債補充供給(3/6~3/7)						
	13,223	13,223	▲1.100	▲4.005		
	37,020	37,020	▲0.350	▲0.401		
	61	61	▲0.350	▲0.350		

マネタリーベース [億円]
 3月3日時点 6,438,300

所要	[億円]
今積期の所要準備額	3,518,100
3月7日以降の残り所要	
積数	600
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

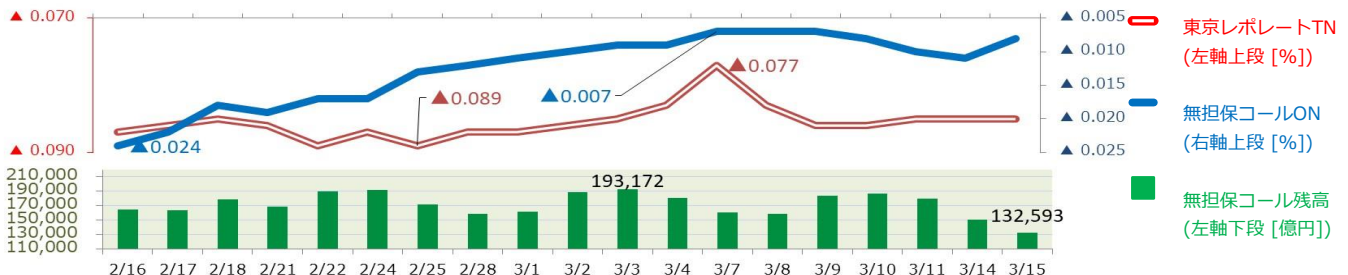
今月の国債買入オペ予定

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