



短期市場の推移

	3月2日	3月3日	3月6日	3月7日
加重平均金利	▲0.011	▲0.010	▲0.011	▲0.011
東京レボレート(TN)	▲0.086	▲0.087	▲0.102	▲0.097
無コール残	171,829	182,042	176,575	186,381
ON	87,081	95,284	91,367	99,263
その他	84,748	86,758	85,208	87,118
有コール残	29,220	29,801	28,231	30,760

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	▲0.012	▲0.089
T/N	-	-	▲0.010	▲0.096
S/N	-	-	▲0.009	-
1W	▲0.040	▲0.009	▲0.031	▲0.111
2W	-	-	▲0.007	▲0.121
3W	-	-	-	▲0.134
1M	-	-	-	▲0.166
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.151
6M	-	-	-	▲0.113
1Y	-	-	-	▲0.085

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9日の予定 (時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
8:50	10-12月期国内総生産(GDP)改定値[前期比年率]	+0.8%	22:30	(米)新規失業保険申請件数[前週分]	-
8:50	2月マネーストック				

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%～▲0.010%の水準で取引された。ビットサイドの調達意欲の若干の弱まりが見られ、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.001%の▲0.012%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.018 ~ ▲0.010	▲0.020 ~ ▲0.020	▲0.015 ~ ▲0.009

営業日のマーケット

ビットサイドの調達意欲の減退から、出合水準は低下を想定。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	3月8日		3月9日		3月10日	
券	+500		▲300		▲1,000	
財政	▲3,200		+2,700		▲4,000	
過不足	▲2,700		+2,400		▲5,000	
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
国庫短期証券買入		+1,000				
国債買入		+300		+27,700		
共通担保(全店)	▲4,300	+6,500				
CP等買入	▲100		▲100			
社債等買入	▲100					
国債補完供給	+46,800	▲48,000	+57,500			
当座預金増減	▲600		+87,500		▲5,000	
当座預金残高	5,193,900		5,281,400		5,276,400	
準備預金残高	4,536,700		主な需給要因			
積み終了先	4,536,600		国庫短期証券			
超過準備	4,536,600		発行・償還(6M)			
非準備先残高	657,200		流動性供給			
準備預金進捗率	99.9%					
平均	75.0%					
乖離率	24.9%					

3月8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)(3/9~)						
5~10年	8,594	8,594				
5~10年	0	0				
5~10年	0	0				
国債買入(3/9~)						
1~3年	4,250	10,309	4,254	0.001	0.002	57.8
3~5年	5,000	9,267	5,005	0.003	0.004	60.7
5~10年	6,750	15,308	6,755	0.000	0.004	14.7
10~25年	3,000	4,051	3,000	0.010	0.018	22.5
CP等買入(3/13~)						
	4,000	7,540	3,980	0.003	0.013	68.1
国債補完供給(3/8~3/9)						
	11,666	11,666	▲1,100	▲3,325		
	36,558	36,558	▲0,350	▲0,388		
	92	92	▲0,350	▲0,350		

マネタリーベース (億円)
3月7日時点 6,464,100

所要	(億円)
今積期の所要準備額	3,515,000
3月9日以降の残り所要	
積数	400
平均	100

国庫短期証券入札予定

3月9日	3ヶ月(第1144回)
3月16日	1年
3月17日	3ヶ月
3月24日	3ヶ月
3月14日	5年
3月16日	20年
3月28日	40年
3月30日	2年

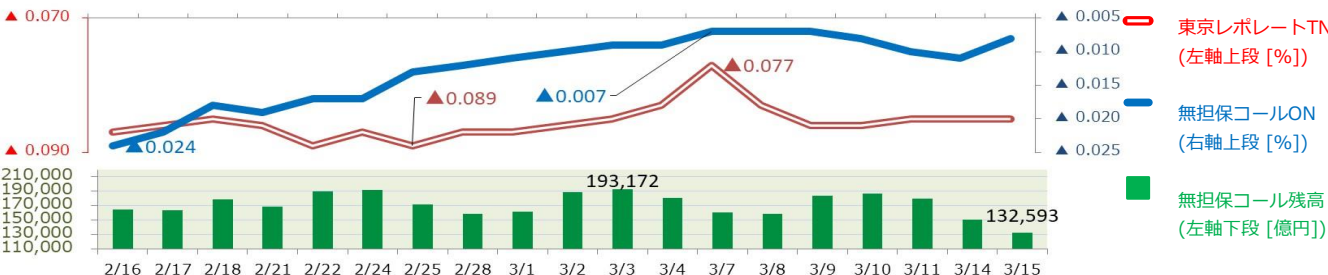
今月の国債買入オペ予定

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	3月3日	0
1年超3年以下	4,250~5,750	4,250	3 8 15 20	3月8日	2
3年超5年以下	5,000~6,500	5,000	3 8 15 29	3月8日	2
5年超10年以下	5,750~7,750	6,750	8 15 20 29	3月8日	3
10年超25年以下	2,000~4,000	3,000	3 8 20 29	3月8日	2
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。