



短期市場の推移

	3月6日	3月7日	3月8日	3月9日
加重平均金利	▲0.011	▲0.011	▲0.012	▲0.017
東京レボレート(TN)	▲0.102	▲0.097	▲0.096	▲0.099
無コール残	176,575	186,381	182,230	183,129
ON	91,367	99,263	100,662	102,581
その他	85,208	87,118	81,568	80,548
有コール残	28,231	30,760	31,491	30,477

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	▲0.070	0.001	▲0.029	▲0.093
T/N	-	-	-	▲0.100
S/N	-	-	▲0.009	-
1W	▲0.023	▲0.018	▲0.019	▲0.117
2W	-	-	▲0.005	▲0.128
3W	-	-	-	▲0.164
1M	-	-	0.150	▲0.174
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.156
6M	-	-	-	▲0.109
1Y	-	-	-	▲0.086

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13日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	-	-
-	-	-	-
-	-	-	-

本日の市況

本日の無担保コールON物は▲0.035%の出合から始まり、その後は主に▲0.038%~▲0.025%の水準で取引された。大手行を中心にビッドサイドの調達意欲は減退し、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.012%の▲0.029%となった。また、本日開催された日銀金融政策決定会合では政策の現状維持が決定された。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.038 ~ ▲0.035	▲0.035 ~ ▲0.035	▲0.030 ~ ▲0.020

翌営業日のマーケット

ビッドサイドの調達意欲の低下から、本日対比横ばい圏での取引を想定。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	3月10日	3月13日	3月13日	3月14日	3月14日	3月14日
券		+500		+600		+0
財政		▲200		+1,600		▲5,000
過不足		+300		+2,200		▲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
国債買入		+1,600		+800		
CP等買入	▲300			+4,000		
社債等買入	▲900					
国債補充供給	+56,500	▲53,500	+65,000			
当座預金増減		+3,700		+72,000		▲5,000
当座預金残高		5,214,500		5,286,500		5,281,500
準備預金残高		4,560,300				主な需給要因
積み終了先		4,560,200				国庫短期証券発行・償還(3M)
超過準備		4,560,200				源泉税揚げ
非準備預金残高		654,200				
準備預金進捗率		99.9%				
平均		89.3%				
乖離率		10.6%				

3月10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)(3/13~)		
5~10年	800	800
5~10年	0	0
5~10年	0	0
5~10年	0	0
5~10年	0	0

国債補充供給(3/10~3/13)			
17,214	16,133	▲1.100	▲3.373
37,721	37,721	▲0.350	▲0.350
0	0		
164	164	▲0.350	▲0.359
15	15	▲3.000	▲3.000

マナタリーベース	所要
3月9日時点	6,480,200
今積期の所要準備額	3,515,000
3月13日以降の残り所要	
積数	100
平均	0

国庫短期証券入札予定

3月16日	1年(第1145回)
3月17日	3ヶ月(第1146回)
3月24日	3ヶ月
4月3日	3ヶ月

国債入札予定

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。 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