



短期市場の推移

	3月8日	3月9日	3月10日	3月13日
加重平均金利	▲0.012	▲0.017	▲0.029	▲0.033
東京レポレート(TN)	▲0.096	▲0.099	▲0.100	▲0.099
無コール残	182,230	183,129	167,256	159,364
ON	100,662	102,581	89,988	89,346
その他	81,568	80,548	77,268	70,018
有コール残	31,491	30,477	30,053	29,255

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	▲0.069	0.001	▲0.033	▲0.094
T/N	-	-	-	▲0.100
S/N	-	-	▲0.005	-
1W	-	-	▲0.025	▲0.117
2W	▲0.007	0.100	0.029	▲0.128
3W	-	-	0.030	▲0.183
1M	-	-	-	▲0.186
2M	-	-	-	-
3M	-	-	0.001	▲0.162
6M	-	-	-	▲0.109
1Y	-	-	-	▲0.086

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15日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	21:30	(米)2月小売売上高 0.2%
-	-	21:30	(米)2月生産者物価コア指数[前年比] -
-	-	-	-

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▲0.033%の合出から始まり、その後は主に▲0.038%~▲0.030%の水準で取引された。ビッドサイドの動向に大きな変化はなく、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比横ばいの▲0.033%となった。

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

翌営業日のマーケット

積み最終日の調整での調達意欲は一定量見られるため、レートは上昇を想定。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	3月14日	3月15日	3月14日	3月15日	3月14日	3月15日
券	▲300			+500		+0
財政	+3,700			▲23,500		+2,000
過不足	+3,400			▲23,000		+2,000
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				
CP等買入	▲300		▲400			
社債等買入			▲100			
国債補完供給	+50,800	▲47,900	+59,300			
当座預金増減	+7,000		+35,800		+2,000	
当座預金残高	5,227,400		5,263,200		5,265,200	
準備預金残高	4,579,900					
積み終了先	4,579,900		国債発行(5年)			
超過準備	4,579,800		個人向け			
非準備先残高	647,500		国債発行・償還			
準備預金進捗率	100.0%					
平均	96.4%					
乖離率	3.6%					

3月14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)(3/15~)						
5~10年	0	0				
5~10年	0	0				
5~10年	0	0				
米ドル資金供給(3/16~3/24)						
	1	1	4,810	4,810		
国債補完供給(3/14~3/15)						
	14,267	14,267	▲1.100	▲2.274		
	33,491	33,491	▲0.350	▲0.351		
	0	0				
	69	69	▲0.350	▲0.360		

マネタリーベース [億円]	所要 [億円]
3月13日時点 6,488,600	今積期の所要準備額 3,515,000
	3月15日以降の残り所要積数 0
	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16日	20年
3月28日	40年
3月30日	2年
4月4日	10年

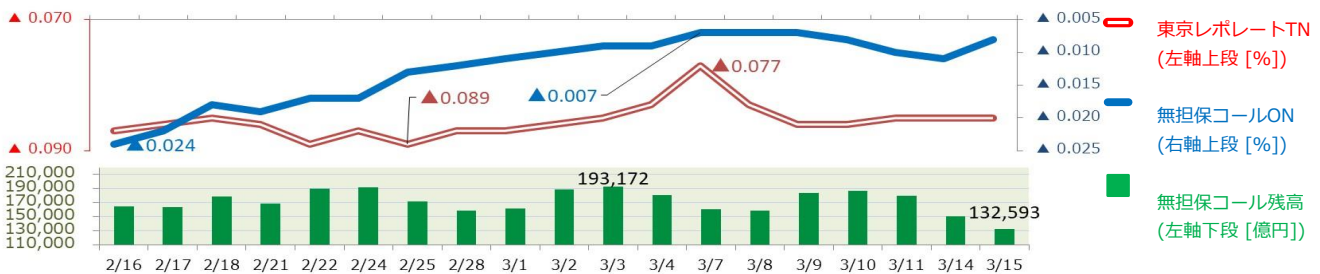
今月の国債買入オペ予定

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