



短期市場の推移

[億円] [%]

	3月9日	3月10日	3月13日	3月14日
加重平均金利	▲0.017	▲0.029	▲0.033	▲0.033
東京レボ レート(TN)	▲0.099	▲0.100	▲0.099	▲0.100
無コール残	183,129	167,256	159,364	163,265
ON	102,581	89,988	89,346	92,847
その他	80,548	77,268	70,018	70,418
有コール残	30,477	30,053	29,255	29,994

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	▲0.023	▲0.091
T/N	-	-	-	▲0.097
S/N	-	-	▲0.005	-
1W	▲0.040	▲0.003	▲0.026	▲0.117
2W	-	-	▲0.020	▲0.132
3W	-	-	-	▲0.187
1M	-	-	0.030	▲0.182
2M	-	-	-	-
3M	-	-	0.011	▲0.161
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16日の予定 (時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
8:50	2月貿易収支	-12353億円	21:30	(米)新規失業保険申請件数 [前週分]	-
17:00	2月の業態別の 日銀当座預金残高		21:30	(米)2月住宅着工件数	131.0万戸
	-		22:15	(欧)3月欧中銀 (ECB) 政策金利	3.50%

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▲0.020%の合出から始まり、その後は主に▲0.025%～ ▲0.010%の水準で取引された。積み期最終日であることから調達ニーズが強まり、ON物加重平均金利 (速報)は前営業日対比+0.010%の▲0.023%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲ 0.025 ~ ▲ 0.020	- ~ -	▲ 0.025 ~ ▲ 0.010

翌営業日のマーケット

翌営業日は新積み期初日のため調達量が増加し、合出水準は本日対比上昇すると予想。

資金需給

[億円]

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	3月15日		3月16日		3月17日	
券	+500		▲300		▲1,000	
財政	▲21,700		+3,200		▲6,000	
過不足	▲21,200		+2,900		▲7,000	
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				+15,600		
CP等買入	▲400		▲500			
社債等買入	▲100					
国債補充供給	+43,200	▲46,300	+57,800			
貸出増加支援					▲37,700	+78,300
当座預金増減	▲24,800		+75,800		+33,600	
当座預金残高	5,202,600		5,278,400		5,312,000	
準備預金残高	4,594,600		4,594,600		4,594,600	
積み終了先	4,594,600		4,594,600		4,594,600	
超過準備	4,594,600		4,594,600		4,594,600	
非準備先残高	608,000		608,000		608,000	
準備預金進捗率	100.0%		100.0%		100.0%	
平均	100.0%		100.0%		100.0%	
乖離率	0.0%		0.0%		0.0%	

3月15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)(3/16~)

5~10年 0 0

5~10年 0 0

5~10年 0 0

国債買入(3/16~)

1~3年 4,250 4,987 4,250 ▲0.019 ▲0.009 46.1

3~5年 5,000 9,047 5,002 ▲0.008 ▲0.005 70.4

5~10年 5,750 14,342 5,754 ▲0.002 0.005 17.9

25年~ 500 2,350 503 0.110 0.116 22.6

国債補充供給(3/15~3/16)

9,395 9,395 ▲1.100 ▲2.445

36,496 36,496 ▲0.350 ▲0.350

0 0

186 186 ▲0.350 ▲0.353

マネタリーベース [億円]

3月14日時点 6,495,800

所要

[億円]

来積期の所要準備額 3,909,200

3月16日以降の残り所要

積数 3,909,200

平均 126,100

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

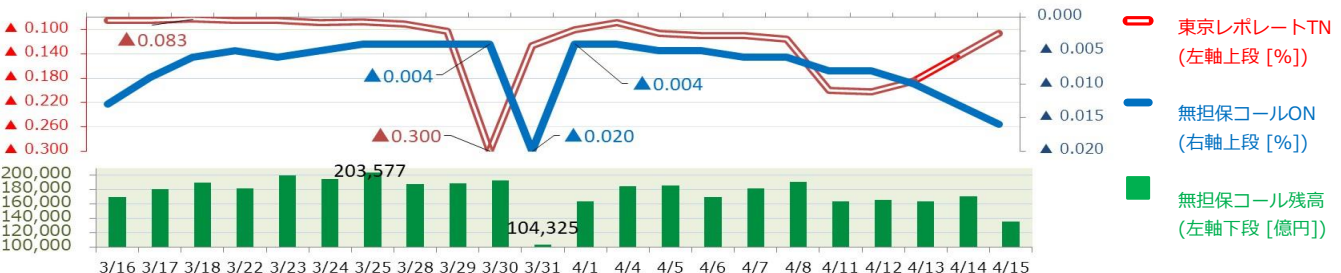
今月の国債買入オペ予定

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

1年前の市場推移

○2022年3月積み期 [3月16日~4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(登金)第 243号 加入協会 日本証券業協会