



短期市場の推移

	3月13日	3月14日	3月15日	3月16日
加重平均金利	▲0.033	▲0.033	▲0.023	▲0.021
東京レボレート(TN)	▲0.099	▲0.100	▲0.097	▲0.097
無コール残	159,364	163,265	158,195	156,309
ON	89,346	92,847	91,207	93,411
その他	70,018	70,418	66,988	62,898
有コール残	29,255	29,994	31,551	29,215

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	▲0.068	0.001	▲0.016	▲0.090
T/N	-	-	-	▲0.096
S/N	-	-	▲0.005	-
1W	▲0.025	▲0.005	▲0.014	▲0.115
2W	▲0.020	▲0.005	▲0.011	▲0.188
3W	-	-	-	▲0.189
1M	-	-	0.005	▲0.184
2M	-	-	-	-
3M	-	-	0.025	▲0.166
6M	-	-	-	▲0.117
1Y	-	-	-	▲0.091

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20日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
金融政策決定会合 における主な意見 (3月9・10日分)			
-		-	
-		-	

本日の市況

本日の無担保コールON物は▲0.015%の出合から始まり、その後は主に▲0.030%～▲0.005%の水準で取引された。週末3日積み要因からビッドサイドの調達意欲の強まりが見られ、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.005%の▲0.016%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.030 ~ ▲0.015	- ~ -	▲0.015 ~ ▲0.003

翌営業日のマーケット

3日積み要因の剥落により出合水準は若干の低下を予想する。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	3月17日	3月20日	3月20日	3月22日		
券	+100	+0	+0	+0		
財政	▲3,600	+82,400	+2,000	+2,000		
過不足	▲3,500	+82,400	+2,000	+2,000		
金融調節	エンド	スタート	エンド	スタート		
共通担保(全店)			▲6,500			
CP等買入	▲500	▲100				
社債等買入	▲100	▲400		+1,000		
国債補充供給	+48,400	▲43,800	+50,000			
貸出増加支援	▲35,900	+78,300				
当座預金増減	+42,900	+131,900	▲3,500			
当座預金残高	5,261,900	5,393,800	5,390,300			
準備預金残高	4,600,400			主な需給要因		
積み終了先	4,593,400	国庫短期証券発行・償還(3M・1Y)				
超過準備	4,424,200	大量償還・利払い				
非準備先残高	661,500					
準備預金進捗率	98.9%					
平均	12.9%					
乖離率	86.0%					

3月17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)(3/20~)						
5~10年	0	0				
5~10年	0	0				
5~10年	0	0				
国債補充供給(3/17~3/20)						
	6,104	6,104	▲1.100	▲2.483		
	37,274	37,274	▲0.350	▲0.351		
	0	0				
	100	100	▲0.350	▲0.350		

マネタリーベース (億円)
 3月16日時点 6,487,200

所要	(億円)
今積期の所要準備額	3,909,200
3月20日以降の残り所要	
積数	42,700
平均	1,600

国庫短期証券入札予定

3月24日	3ヶ月(第1147回)
4月3日	3ヶ月
4月6日	6ヶ月
4月7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 近畿財務局長(登金)第243号 加入協会 日本証券業協会