



短期市場の推移

	3月14日	3月15日	3月16日	3月17日
加重平均金利	▲0.033	▲0.023	▲0.021	▲0.016
東京レポレート(TN)	▲0.100	▲0.097	▲0.097	▲0.096
無コール残	163,265	158,195	156,309	174,854
ON	92,847	91,207	93,411	104,306
その他	70,418	66,988	62,898	70,548
有コール残	29,994	31,551	29,215	31,081

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	▲0.068	0.001	▲0.015	▲0.090
T/N	-	-	-	▲0.097
S/N	-	-	▲0.005	-
1W	▲0.020	▲0.005	▲0.008	▲0.115
2W	-	-	-	▲0.198
3W	-	-	-	▲0.195
1M	-	-	-	▲0.190
2M	-	-	-	-
3M	-	-	0.025	▲0.173
6M	-	-	-	▲0.120
1Y	-	-	-	▲0.095

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22日の予定 (時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
	-			FOMC	
	-			-	
	-			-	

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▲0.025%~▲0.007%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+0.001%の▲0.015%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.025 ~ ▲0.020	- ~ -	▲0.015 ~ ▲0.006

翌営業日のマーケット

オファー・ビッドの動向に大きな変化はなく、出合いの水準は本日対比横ばい圏と予想。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	3月20日	3月22日	3月22日	3月23日	3月23日	3月23日
券	▲100	▲100	▲100	▲2,000	▲2,000	▲2,000
財政	+81,800	+2,400	+2,400	+4,000	+4,000	+4,000
過不足	+81,700	+2,300	+2,300	+2,000	+2,000	+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
国債買入				+13,200		
共通担保(全店)			▲6,500	+8,500		
CP等買入	▲100		▲800			
社債等買入	▲400			+1,000		
国債補充供給	+43,800	▲49,400	+55,700			
当座預金増減	+75,600	+73,400	+73,400	+2,000	+2,000	+2,000
当座預金残高	5,337,500	5,410,900	5,410,900	5,412,900	5,412,900	5,412,900
準備預金残高	4,663,600	主な需給要因				
積み終了先	4,660,000					
超過準備	4,658,000					
非準備先残高	673,900					
準備預金進捗率	99.2%					
平均	19.4%					
乖離率	79.8%					

3月20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)(3/20~)						
5~10年	0	0				
5~10年	0	0				
5~10年	0	0				
国債買入(3/22~)						
1~3年	4,250	9,027	4,256	▲0.009	▲0.008	78.5
5~10年	5,750	13,311	5,755	▲0.035	▲0.033	95.2
10~25年	2,000	2,521	2,001	▲0.033	▲0.017	48.9
25年~	1,000	2,299	1,003	▲0.013	▲0.008	14.2
米ドル資金供給(3/23~3/30)						
	0	0	4,940	4,940		
国債補充供給(3/20~3/22)						
	5,180	5,149	▲1,100	▲2,729		
	43,822	43,822	▲0.350	▲0.355		
	0	0				
	119	119	▲0.350	▲0.351		
共通担保(全店)(3/22~4/5)						
	8,501	8,501				

マナリーベース	所要
3月17日時点	6,530,000
今積期の所要準備額	3,909,200
3月22日以降の残り所要	
積数	31,600
平均	1,300

国庫短期証券入札予定

入札日	期間
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

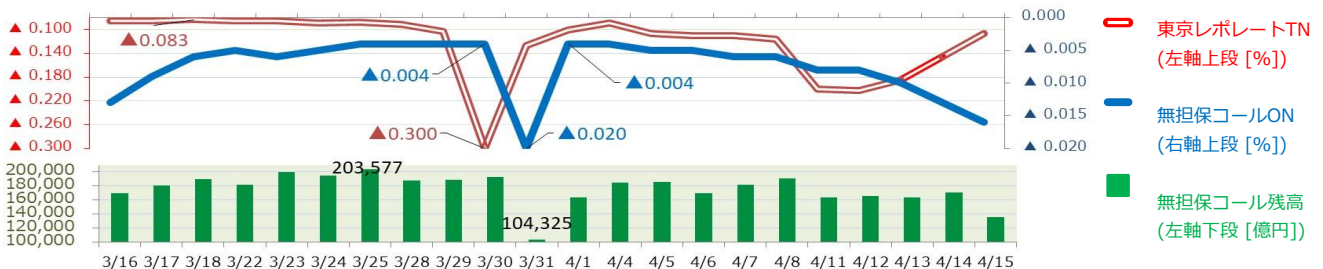
今月の国債買入オペ予定

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	0
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	1
10年超25年以下	2,000~4,000	2,000	3 8 20 29	3月8日	1
25年超	1,000~3,000	1,000	3 15 20	3月15日	0
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