



短期市場の推移

[億円] [%]

	3月15日	3月16日	3月17日	3月20日
加重平均金利	▲0.023	▲0.021	▲0.016	▲0.015
東京レポレート(TN)	▲0.097	▲0.097	▲0.096	▲0.097
無コール残	158,195	156,309	174,854	166,775
ON	91,207	93,411	104,306	96,072
その他	66,988	62,898	70,548	70,703
有コール残	31,551	29,215	31,081	30,217

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

3月23日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	3:00 (米)3月連邦公開市場委員会(FOMC)政策金利	5.00%
-	-	21:00 (英)3月英中銀 (BOE) 政策金利	4.25%
-	-	21:30 (米)新規失業保険申請件数 [前週分]	-

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▲0.007%の割合から始まり、その後は主に▲0.020%～ ▲0.005%の水準で取引された。大手行の調達意欲がやや強まり、ON物加重平均金利 (速報) は前営業日対比+0.001%の▲0.014%となった。

	最低	最高	平均	東京レポレート
O/N	▲0.068	0.001	▲0.014	▲0.091
T/N	-	-	-	▲0.096
S/N	-	-	▲0.005	-
1W	▲0.040	▲0.003	▲0.030	▲0.114
2W	▲0.027	▲0.018	▲0.022	▲0.198
3W	-	-	-	▲0.196
1M	-	-	0.015	▲0.189
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.174
6M	-	-	-	▲0.122
1Y	-	-	-	▲0.096

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

都銀・信託	証券	地銀
▲0.020 ~ ▲0.013	- ~ -	▲0.015 ~ ▲0.005

翌営業日のマーケット

市場動向に大きな変化はなく、出会いの水準は本日対比横ばい圏と予想。

資金需給

[億円]

	日銀速報	日銀予想	当社需給予想
	3月22日	3月23日	3月24日
券	▲100	▲1,000	▲1,000
財政	▲3,400	+16,700	+2,000
過不足	▲3,500	+15,700	+1,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国庫短期証券買入		▲1,000	
国債買入			
共通担保(全店)	▲6,500	+8,500	
CP等買入	▲800	▲200	
社債等買入		+1,000	▲100
国債補完供給	+49,300	▲47,800	+54,000
当座預金増減	+13,400	+70,400	+1,000
当座預金残高	5,350,900	5,421,300	5,422,300
準備預金残高	4,679,000		
積み終了先	4,676,200		
超過準備	4,675,600		
非準備先残高	671,900		
準備預金進捗率	99.3%		
平均	22.6%		
乖離率	76.7%		

3月22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
国庫短期証券買入(3/23~)	1,000	5,700	1,000	0.022	0.022	
国債買入(固定利回り方式)(3/23~)						
5~10年	0	0				
5~10年	0	0				
米ドル資金供給(3/24~3/30)						
	0	0	5,040	5,040		
国債補完供給(3/22~3/23)	4,407	4,152	▲1,100	▲3,389		
	42,929	42,929	▲0.350	▲0.350		
	0	0				
	255	255	▲3,000	▲3,000		

マネタリーベース [億円]
3月20日時点 6,605,600

所要	[億円]
今積期の所要準備額	3,909,200
3月23日以降の残り所要	
積数	28,200
平均	1,200

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

国債入札予定

3月28日	40年
3月30日	2年
4月4日	10年
4月6日	30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