



短期市場の推移

[億円] [%]

	3月16日	3月17日	3月20日	3月22日
加重平均金利	▲0.021	▲0.016	▲0.015	▲0.014
東京レボ レート(TN)	▲0.097	▲0.096	▲0.097	▲0.096
無コール残	156,309	174,854	166,775	173,463
ON	93,411	104,306	96,072	101,710
その他	62,898	70,548	70,703	71,753
有コール残	29,215	31,081	30,217	30,380

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	▲0.013	▲0.100
T/N	-	-	-	▲0.113
S/N	▲0.005	0.001	▲0.005	-
1W	▲0.025	▲0.004	▲0.018	▲0.119
2W	▲0.020	0.150	0.001	▲0.196
3W	-	-	0.010	▲0.193
1M	-	-	▲0.008	▲0.187
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.175
6M	-	-	-	▲0.123
1Y	-	-	-	▲0.097

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

資金需給

[億円]

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	3月23日		3月24日		3月27日	
券	▲1,000		+200		+0	
財政	+15,900		+30,100		+19,000	
過不足	+14,900		+30,300		+19,000	
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	▲200		▲400			
社債等買入	▲100		▲100			
E T F 買入				+700		
国債補完供給	+47,400	▲43,600	+47,200			
当座預金増減		+19,400		+77,700		+19,000
当座預金残高		5,370,300		5,448,000		5,467,000
準備預金残高		4,684,300				
積み終了先		4,681,500				
超過準備		4,681,500				
非準備先残高		686,000				
準備預金進捗率		99.3%				
平均		25.8%				
乖離率		73.5%				

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

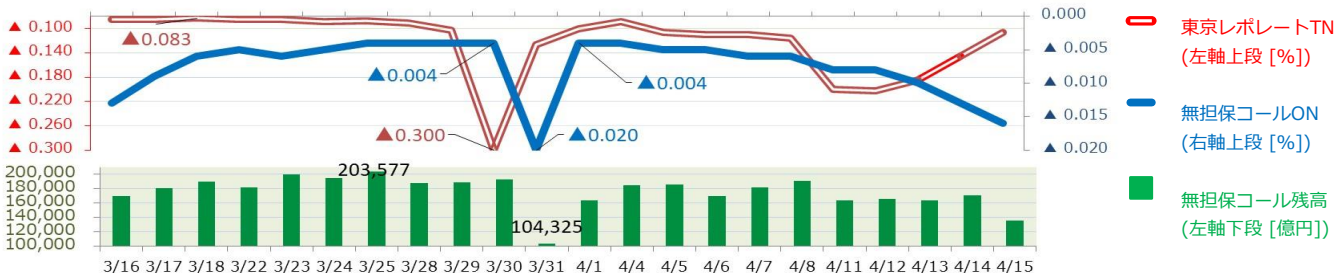
今月の国債買入オペ予定

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