



短期市場の推移

	3月17日	3月20日	3月22日	3月23日
加重平均金利	▲0.016	▲0.015	▲0.014	▲0.013
東京レボレート(TN)	▲0.096	▲0.097	▲0.096	▲0.113
無コール残	174,854	166,775	173,463	166,723
ON	104,306	96,072	101,710	93,670
その他	70,548	70,703	71,753	73,053
有コール残	31,081	30,217	30,380	28,403

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	▲0.055	0.001	▲0.009	▲0.101
T/N	-	-	-	▲0.118
S/N	-	-	▲0.005	-
1W	▲0.018	0.050	▲0.006	▲0.207
2W	-	-	-	▲0.201
3W	-	-	-	▲0.194
1M	-	-	-	▲0.187
2M	-	-	-	-
3M	-	-	0.480	▲0.175
6M	-	-	-	▲0.121
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

3月27日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	-	-
-	-	-	-
-	-	-	-

本日の市況

本日の無担保コールON物は▲0.005%の合出から始まり、その後は主に▲0.010%～▲0.003%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が強まり、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.004%の▲0.009%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.010 ~ ▲0.010	▲0.006 ~ ▲0.006	▲0.010 ~ ▲0.003

翌営業日のマーケット

週末3日積み要因の剥落から調達意欲は減退し、出合水準は本日対比低下を予想。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	3月24日	3月27日	3月27日	3月28日	3月28日	3月28日
券	+200	+700	+700	▲1,000		
財政	+29,300	+40,900	+40,900	+7,000		
過不足	+29,500	+41,600	+41,600	+6,000		
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
CP等買入	▲400		▲500			
社債等買入	▲100					
E T F買入	+700					
国債補充供給	+43,600	▲42,600	+46,200			
当座預金増減	+30,700	+87,300	+87,300	+6,000		
当座預金残高	5,401,000	5,488,300	5,488,300	5,494,300		
準備預金残高	4,720,100				主な需給要因	
積み終了先	4,719,000				国庫短期証券発行・償還(3M)	
超過準備	4,718,300				地方公共団体への貸付	
非準備預金先高	680,900					
準備預金進捗率	99.5%					
平均	35.5%					
乖離率	64.0%					

3月24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)(3/27~)						
5~10年	0	0				
5~10年	0	0				
米ドル資金供給(3/28~4/4)						
	0	0	5.060	5.060		
国債補充供給(3/24~3/27)						
	2,733	2,733	▲1.100	▲3.734		
	39,309	39,309	▲0.350	▲0.350		
	276	276	▲0.350	▲0.350		

マネタリーベース (億円)
3月23日時点 6,639,500

所要	(億円)
今積期の所要準備額	3,909,200
3月27日以降の残り所要	
積数	19,800
平均	1,000

国庫短期証券入札予定

4月3日	3ヶ月
4月6日	6ヶ月
4月7日	3ヶ月
4月14日	3ヶ月

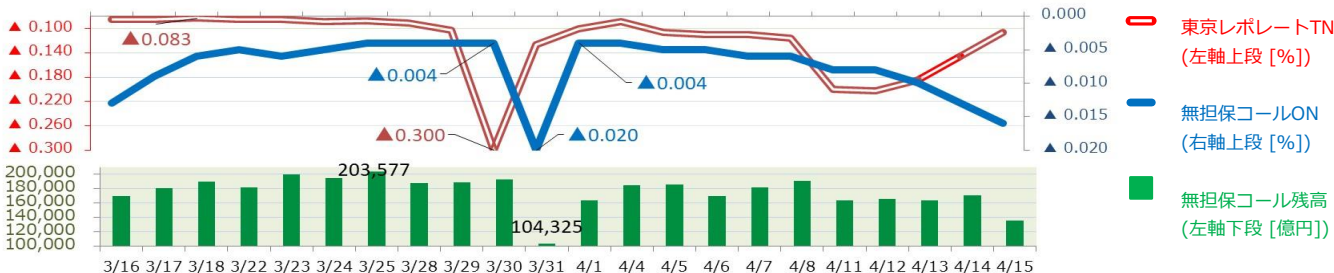
今月の国債買入オペ予定

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