



短期市場の推移

	3月20日	3月22日	3月23日	3月24日
加重平均金利	▲0.015	▲0.014	▲0.013	▲0.009
東京レポレート(TN)	▲0.097	▲0.096	▲0.113	▲0.118
無コール残	166,775	173,463	166,723	168,448
ON	96,072	101,710	93,670	96,095
その他	70,703	71,753	73,053	72,353
有コール残	30,217	30,380	28,403	30,323

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	▲0.060	0.001	▲0.014	▲0.149
T/N	-	-	-	▲0.197
S/N	-	-	-	-
1W	0.001	0.030	0.006	▲0.309
2W	-	-	0.003	▲0.267
3W	-	-	-	▲0.223
1M	-	-	-	▲0.205
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.186
6M	-	-	-	▲0.126
1Y	-	-	-	▲0.099

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28日の予定 (時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想

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▲0.008%の合出から始まり、その後は主に▲0.018%~ ▲0.005%の水準で取引された。週末3日積み要因の剥落によりビッドサイドの調達意欲が弱まり、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.005%の▲0.014%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.018 ~ ▲0.013	▲0.015 ~ ▲0.015	▲0.017 ~ ▲0.005

翌営業日のマーケット

オファービッド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を予想。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	3月27日	3月28日	3月28日	3月29日	3月29日	3月29日
債券	+700	+100	+100	+1,000		
財政	+39,900	+18,000	+18,000	▲7,000		
過不足	+40,600	+18,100	+18,100	▲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	▲500	▲700	▲700			
国債補充供給	+42,600	▲44,000	+47,600			
当座預金増減	+38,700	+65,000	+65,000	▲6,000		
当座預金残高	5,439,700	5,504,700	5,504,700	5,498,700		
準備預金残高	4,752,900	主な需給要因				
積み終了先	4,751,100	国債発行(40年)				
超過準備	4,751,100					
非準備先残高	686,800					
準備預金進捗率	99.5%					
平均	38.7%					
乖離率	60.8%					

3月27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)(3/28~)						
5~10年	0	0				
5~10年	0	0				
米ドル資金供給(3/29~4/5)						
	0	0	5,050	5,050		
国債補充供給(3/27~3/28)						
	1,917	1,917	▲1,100	▲2,942		
	41,792	41,792	▲0,350	▲0,350		
	13	13	▲0,350	▲0,350		

マネタリーベース

3月24日時点 6,670,000

所要

今積期の所要準備額	3月28日以降の残り所要
3,909,200	積数 18,000
	平均 900

国債短期証券入札予定

4月3日	3ヶ月(第1148回)
4月6日	6ヶ月
4月7日	3ヶ月
4月14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

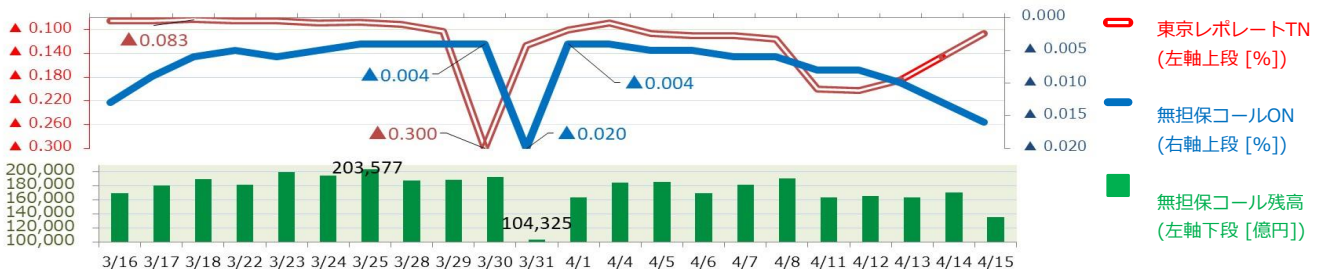
今月の国債買入オペ予定

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