



短期市場の推移

	3月22日	3月23日	3月24日	3月27日
加重平均金利	▲0.014	▲0.013	▲0.009	▲0.014
東京レボレート(TN)	▲0.096	▲0.113	▲0.118	▲0.197
無コール残	173,463	166,723	168,448	168,389
ON	101,710	93,670	96,095	95,636
その他	71,753	73,053	72,353	72,753
有コール残	30,380	28,403	30,323	29,275

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	▲0.015	▲0.187
T/N	-	-	-	▲0.251
S/N	-	-	0.001	-
1W	-	-	0.130	▲0.360
2W	-	-	0.005	▲0.296
3W	-	-	-	▲0.239
1M	-	-	-	▲0.213
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.190
6M	-	-	-	▲0.128
1Y	-	-	-	▲0.100

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29日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	(米) 週間のMBA住宅ローン申請指数	-
-	-	-	-
-	-	-	-

本日の市況

本日の無担保コールON物は▲0.009%の合出から始まり、その後は主に▲0.018%~ ▲0.008%の水準で取引された。動向に大幅な変化は見られず、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
▲0.019 ~ ▲0.018	- ~ -	▲0.020 ~ ▲0.007

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、出合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28日	3月29日	3月29日	3月30日	3月30日
券		+0	+100	▲1,000	
財政		+19,800	+7,200	+34,500	
過不足		+19,800	+7,300	+33,500	
金融調節	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド
国庫短期証券買入				+1,000	
CP等買入	▲700		▲400		
国債補完供給	+44,000	▲39,400	+43,100		
当座預金増減		+23,700	+51,000	+33,500	
当座預金残高		5,463,400	5,514,400	5,547,900	
準備預金残高		4,776,100			主な需給要因
積み終了先		4,774,600	国債発行(40年)	年度末諸払い	
超過準備		4,774,600			
非準備先残高		687,300			
準備預金進捗率		99.6%			
平均		41.9%			
乖離率		57.6%			

3月28日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
国庫短期証券買入(3/29~)	1,000	2,625	1,000	0.012	0.012	50.0
国債買入(固定利回り方式)(3/29~)						
5~10年	0	0				
5~10年	0	0				
米ドル資金供給(3/30~4/6)			0	0	5.070	5.070
CP等買入(3/31~)	4,000	5,175	3,985	0.002	0.018	50.0
国債補完供給(3/28~3/29)						
	1,501	1,501	▲1,200	▲2.218		
	37,502	37,502	▲0.450	▲0.450		
	153	153	▲0.450	▲0.450		

マネタリーベース (億円)
 3月27日時点 6,707,900

所要	(億円)
今積期の所要準備額	3,909,200
3月29日以降の残り所要	
積数	16,500
平均	900

国庫短期証券入札予定

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

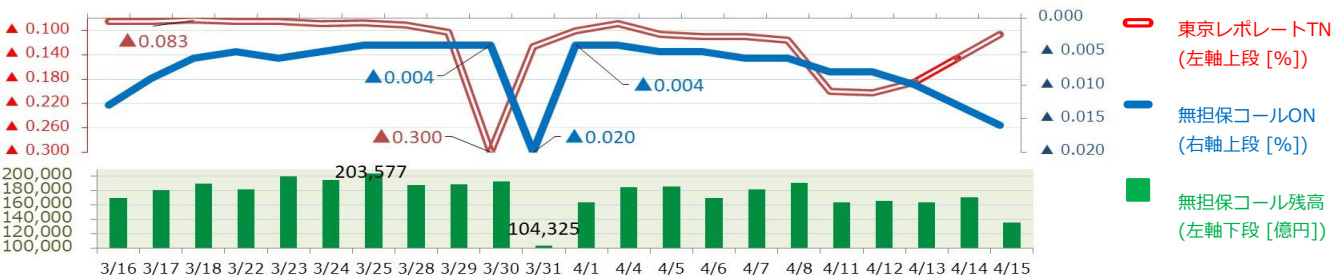
今月の国債買入オペ予定

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