



短期市場の推移

	3月23日	3月24日	3月27日	3月28日
加重平均金利	▲0.013	▲0.009	▲0.014	▲0.015
東京レボレート(TN)	▲0.113	▲0.118	▲0.197	▲0.251
無コール残	166,723	168,448	168,389	166,981
ON	93,670	96,095	95,636	93,938
その他	73,053	72,353	72,753	73,043
有コール残	28,403	30,323	29,275	27,980

3月30日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	21:30 (米)新規失業保険申請件数 [前週分]	-
-	-	21:30 (米)10-12月期国内総生産 (GDP) 確定値[前期比年率]	2.7%
-	-	-	-

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 [%]

経済指標及び予想値は株式会社フィスコ提供

	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	▲0.191
T/N	-	-	-	▲0.331
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.015	0.010	▲0.009	▲0.414
2W	-	-	▲0.020	▲0.321
3W	-	-	-	▲0.261
1M	-	-	-	▲0.230
2M	-	-	-	-
3M	-	-	0.008	▲0.190
6M	-	-	-	▲0.129
1Y	-	-	-	▲0.100

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%～▲0.008%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)は前営業日対比横ばい圏の▲0.015%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.018 ~ ▲0.018	- ~ -	▲0.020 ~ ▲0.008

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圏を想定。

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	日銀速報			日銀予想			当社需給予想		
	3月29日			3月30日			3月31日		
券		+100			▲400			+1,400	
財政		+5,400			+27,300			+56,000	
過不足		+5,500			+26,900			+57,400	
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	エンド	スタート	
国庫短期証券買入								+1,000	
国債買入								+13,700	
CP等買入		▲400			▲500			+4,000	
国債補充供給	+40,000	▲43,800			+46,500				
新型コロナ対応金融支援特別								▲81,400	
当座預金増減		+2,300			+86,600			▲20,000	
当座預金残高		5,465,700			5,552,300			5,532,300	
準備預金残高		4,782,300	主な需給要因						
積み終了先		4,781,900	年度末諸払い		年度末諸払い				
超過準備		4,781,600							
非準備先残高		683,400							
準備預金進捗率		99.6%							
平均		45.2%							
乖離率		54.4%							

3月29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)(3/30~)						
5~10年	0	0				
5~10年	0	0				
国債買入(3/30~)						
3~5年	5,000	13,138	5,007	▲0.001	0.000	75.9
5~10年	5,750	9,614	5,760	▲0.013	▲0.008	41.9
10~25年	2,000	4,764	2,005	▲0.013	▲0.010	31.1
物価連動	600	1,543	601	▲0.220	▲0.536	10.9
米ドル資金供給(3/31~4/7)						
	0	0	5,060	5,060		
国債補充供給(3/29~3/30)						
	1,430	1,430	▲1,300	▲2,125		
	42,102	42,102	▲0,550	▲0,551		
	0	0				

マネタリーベース	所要
3月28日時点	6,731,600
今積期の所要準備額	3,909,200
3月30日以降の残り所要	
積数	15,800
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

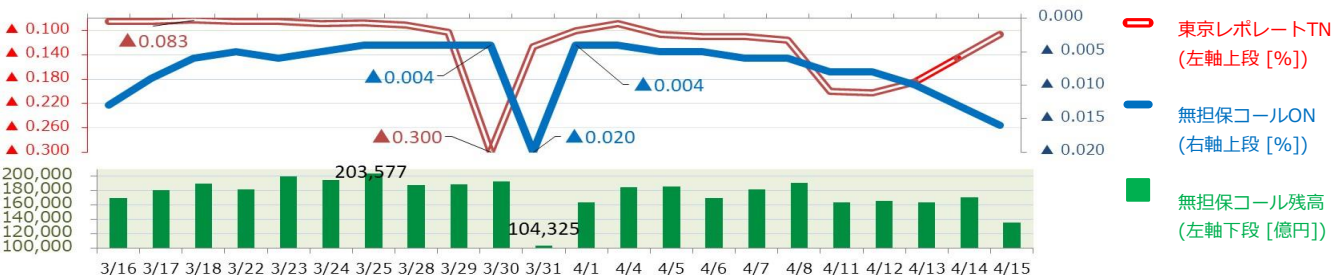
今月の国債買入オペ予定

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20日	0
3年超5年以下	5,000~6,500	5,000	3 8 15 29	3月29日	0
5年超10年以下	5,750~7,750	5,750	8 15 20 29	3月29日	0
10年超25年以下	2,000~4,000	2,000	3 8 20 29	3月29日	0
25年超	1,000~3,000	1,000	3 15 20	3月20日	0
物価連動債	600	600	月1回	3月29日	0
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