



短期市場の推移

	3月27日	3月28日	3月29日	3月30日
加重平均金利	▲0.014	▲0.015	▲0.015	▲0.014
東京レポレート(TN)	▲0.197	▲0.251	▲0.331	▲1.205
無コール残	168,389	166,981	164,754	169,903
ON	95,636	93,938	93,013	97,567
その他	72,753	73,043	71,741	72,336
有コール残	29,275	27,980	26,868	26,849

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	▲0.087	0.001	▲0.030	▲0.150
T/N	-	-	▲0.001	▲0.118
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.027	▲0.025	▲0.027	▲0.144
2W	-	-	▲0.005	▲0.149
3W	0.040	0.050	0.045	▲0.159
1M	-	-	▲0.020	▲0.171
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.179
6M	-	-	-	▲0.129
1Y	-	-	-	▲0.100

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

4月3日の予定 (時刻は日本時間)

時刻	日本	予想	海外	予想
	8:50	1-3月期日銀短観 (大企業製造業DI)	3	23:00 (米)3月ISM製造業 景況指数
	-	-	-	-
	-	-	-	-

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▲0.020%の出会いから始まり、その後は主に▲0.050%~▲0.015%の水準で取引された。年度末のため調達を控える先があり、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.016%の▲0.030%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.050 ~ ▲0.035	- ~ -	▲0.020 ~ ▲0.010

翌営業日のマーケット

年度末で調達を控えていた先が再開し、出会いの水準は上昇すると予想。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	3月31日	4月3日	4月3日	4月4日	4月4日	4月4日
券	+800		+600		▲1,000	
財政	+24,000		▲33,400		▲9,000	
過不足	+24,800		▲32,800		▲10,000	
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	▲6,900	+4,000	▲100			
国債補充供給	+56,600	▲51,900	+53,700			
新型コロナ対応金融支援特別	▲81,400	+51,900				
当座預金増減	▲2,900		+20,800		▲10,000	
当座預金残高	5,490,800		5,511,600		5,501,600	
準備預金残高	4,859,200		主な需給要因			
積み終了先	4,859,100		法人税、消費税、			
超過準備	4,854,400		保険揚げ			
非準備先残高	631,600		普通交付税			
準備預金進捗率	99.9%					
平均	58.1%					
乖離率	41.8%					

3月31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)(4/3~)						
5~10年	0	0				
5~10年	0	0				
米ドル資金供給(4/4~4/11)						
	0	0	5,060	5,060		
国債補充供給(3/31~4/3)						
	1,845	1,845	▲2,200	▲2,886		
	49,765	49,765	▲1,450	▲1,450		
	40	40	▲1,450	▲1,460		

マネタリーベース [億円]
3月30日時点 6,762,100

所要	[億円]
今積期の所要準備額	3,909,200
4月3日以降の残り所要	
積数	800
平均	100

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(第1149回)
4月7日	3ヶ月(第1150回)
4月14日	3ヶ月

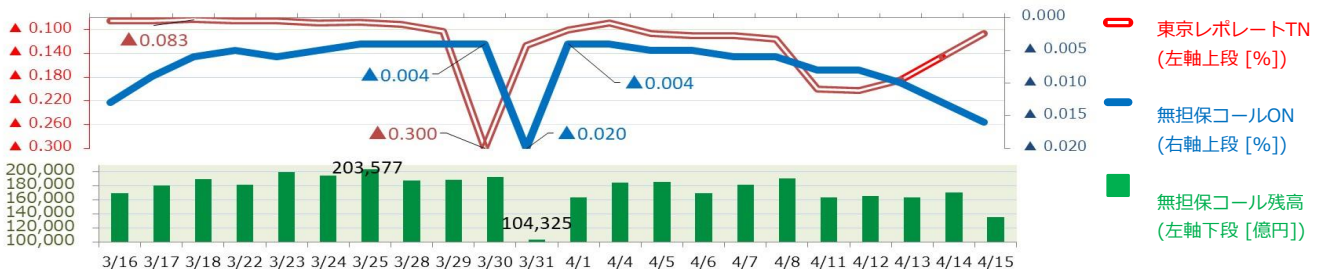
来月の国債買入オペ予定

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	1
1年超3年以下	3,500~6,500	4,250	5 10 14 21	3月20日	4
3年超5年以下	4,250~7,250	5,000	5 14 21 27	3月29日	4
5年超10年以下	4,750~8,750	5,750	10 14 21 27	3月29日	4
10年超25年以下	1,000~5,000	2,000	5 10 21 27	3月29日	4
25年超	500~3,500	1,000	10 14 24	3月20日	3
物価連動債	600	600	月1回	3月29日	1
変動利付債<四半期>	300	300	四半期に1回	1月12日	1

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