



短期市場の推移 [億円] [%]

	3月10日	3月13日	3月14日	3月15日
加重平均金利	▲0.029	▲0.033	▲0.033	▲0.023
東京レポレート(TN)	▲0.100	▲0.099	▲0.100	▲0.097
無コール残	167,256	159,364	163,265	158,195
ON	89,988	89,346	92,847	91,207
その他	77,268	70,018	70,418	66,988
有コール残	30,053	29,255	29,994	31,551

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	▲0.070	0.001	▲0.021	▲0.090
T/N	-	-	-	▲0.097
S/N	-	-	▲0.005	-
1W	▲0.025	▲0.015	▲0.022	▲0.117
2W	▲0.020	▲0.008	▲0.016	▲0.135
3W	-	-	-	▲0.190
1M	-	-	-	▲0.183
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.162
6M	-	-	-	▲0.111
1Y	-	-	-	▲0.087

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17日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
10~12月資金循環速報 (日銀)		23:00 (米)2月景気先行指数	-0.2%
-	-	(欧)2月の消費者物価(確報)	
-	-	-	-

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▲0.015%の出合から始まり、その後は主に▲0.030%~▲0.008%の水準で取引された。3月積み期の初日は、ビッドサイドの調達意欲は底堅く推移し一部取りあがる動きも見られたためON物加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.002%の▲0.021%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.030 ~ ▲0.020	▲0.024 ~ ▲0.024	▲0.015 ~ ▲0.008

翌営業日のマーケット

3日積みのため資金調達ニーズは強まり、出合水準は本日対比で上昇すると予想。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	3月16日	3月17日	3月17日	3月20日	3月20日	3月20日
券	▲200		+0		+0	
財政	+2,200		▲3,300		+78,000	
過不足	+2,000		▲3,300		+78,000	
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
国債買入		+15,600				
CP等買入	▲500		▲500			
社債等買入			▲100			
国債補充供給	+47,900	▲48,600	+55,600			
貸出増加支援			▲35,900	+78,300		
当座預金増減	+16,400		+94,100		+78,000	
当座預金残高	5,219,000		5,313,100		5,391,100	
準備預金残高	4,553,900					
積み終了先	2,978,700		国債発行(20年)	国庫短期証券発行・償還(3M・1Y)		
超過準備	1,216,700			大量償還・利払い		
非準備先残高	665,100					
準備預金進捗率	85.4%					
平均	3.2%					
乖離率	82.1%					

3月16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)(3/17~)						
5~10年	0	0				
5~10年	0	0				
5~10年	0	0				
社債等買入(3/22~)						
1,000	2,121	1,000	0.243	0.279	64.3	
国債補充供給(3/16~3/17)						
8,921	8,921	▲1,100	▲2.278			
39,490	39,490	▲0.350	▲0.350			
0	0					
62	62	▲0.350	▲0.360			

マネタリーベース [億円]
3月15日時点 6,470,500

所要	[億円]
今積期の所要準備額	3,909,200
3月17日以降の残り所要	
積数	572,000
平均	19,100

国庫短期証券入札予定

3月17日	3ヶ月(第1146回)
3月24日	3ヶ月
4月3日	3ヶ月
4月6日	6ヶ月

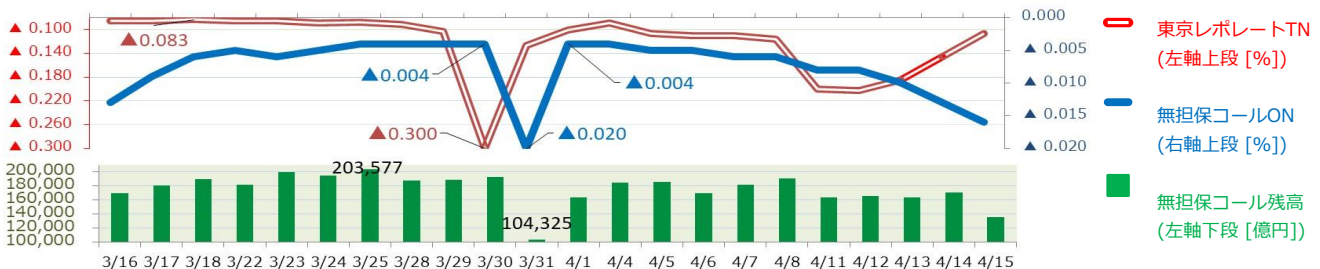
今月の国債買入オペ予定

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	1
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	2
10年超25年以下	2,000~4,000	3,000	3 8 20 29	3月8日	2
25年超	1,000~3,000	500	3 15 20	3月15日	1
物価運動債	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