



短期市場の推移

[億円] [%]

	2月25日	2月26日	3月1日	3月2日
加重平均金利	▲0.022	▲0.022	▲0.024	▲0.022
東京レボレート(TN)	▲0.094	▲0.095	▲0.090	▲0.088
無コール残	127,433	138,475	133,791	117,470
ON	78,975	92,122	86,088	70,187
その他	48,458	46,353	47,703	47,283
有コール残	20,559	21,066	21,151	20,782

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	▲0.075	0.001	▲0.020	▲0.083
T/N	▲0.010	▲0.001	▲0.005	▲0.086
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.010	▲0.007	▲0.010	▲0.089
2W	-	-	▲0.007	▲0.092
3W	-	-	-	▲0.095
1M	-	-	-	▲0.104
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.106
6M	-	-	-	▲0.112
1Y	-	-	-	▲0.137

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

[億円]

	日銀速報	日銀予想	当社需給予想
	3月3日	3月4日	3月5日
券	▲100	▲400	▲1,000
財政	▲74,900	+2,000	+6,000
過不足	▲75,000	+1,600	+5,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国庫短期証券買入	+15,000		
CP等買入	▲100	▲100	
国債補完供給	+100	+400	
成長基盤強化支援	▲4,100	+6,800	
当座預金増減	▲57,700	+1,900	+5,000
当座預金残高	4,829,800	4,831,700	4,836,700
準備預金残高	4,252,000	主な需給要因	
積み終了先	4,251,900		
超過準備	4,251,900		
非準備先残高	577,800		
準備預金進捗率	99.9%	国債発行(30年)	
平均	57.1%		
乖離率	42.8%		

3月3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
国債補完供給(3/3~3/4)	361	361	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マネタリーベース [億円]

3月2日時点 6,096,400

所要

[億円]

今積期の所要準備額	3,263,100
3月4日以降の残り所要	
積数	200
平均	0

国庫短期証券入札予定

3月5日	3ヶ月 第977回
3月9日	6ヶ月 第978回
3月12日	3ヶ月
3月17日	1年
国債入札予定	
3月4日	30年
3月9日	5年
3月11日	20年
3月25日	40年

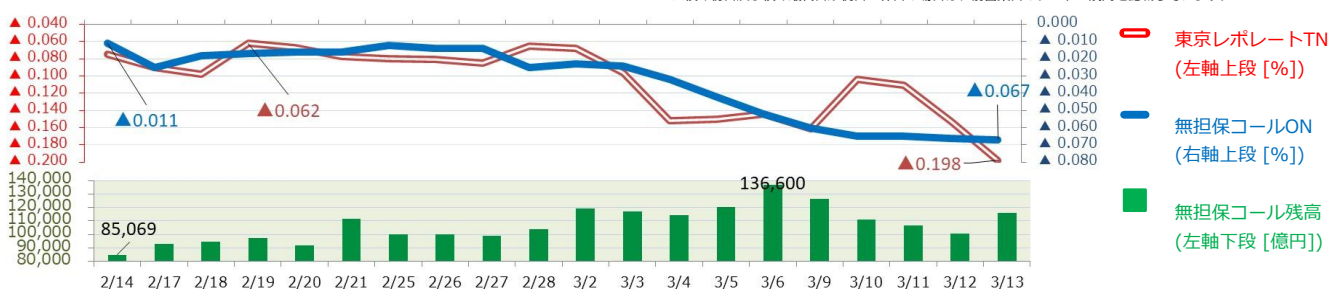
今月の国債買入オペ予定

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	500~1,500	1,000	月2回程度	3月1日	1
1年超3年以下	2,500~5,500	4,000	5 12 17 22 26	2月25日	5
3年超5年以下	2,000~5,500	3,700	1 5 17 22 31	3月1日	4
5年超10年以下	2,500~6,000	4,200	5 12 17 22 26	2月25日	5
10年超25年以下	500~2,000	1,200	17 31	2月22日	2
25年超	0~500	300	12 31	2月22日	2
物価連動債	300	300	月2回程度	2月22日	2
変動利付債<偶数月>	500	500	月1回	2月22日	-

1年前の市場推移

○2020年2月積み期 [2月14日~3月13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