



短期市場の推移

	3月2日	3月3日	3月4日	3月5日
加重平均金利	▲0.022	▲0.020	▲0.016	▲0.014
東京レボレート(TN)	▲0.088	▲0.086	▲0.080	▲0.076
無コール残	117,470	117,550	112,629	120,859
ON	70,187	70,267	64,686	66,566
その他	47,283	47,283	47,943	54,293
有コール残	20,782	21,336	21,486	21,002

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	▲0.014	▲0.069
T/N	▲0.010	▲0.001	▲0.004	▲0.071
S/N	-	-	▲0.010	-
1W	▲0.020	▲0.009	▲0.014	▲0.079
2W	-	-	-	▲0.087
3W	-	-	▲0.005	▲0.091
1M	-	-	-	▲0.103
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.105
6M	-	-	-	▲0.112
1Y	-	-	-	▲0.138

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9日の予定 (時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
8:50	10-12月期国内総生産 (GDP)改定値 [前期比年率]	+12.6%	19:00	(欧)10-12月期域内総生産 (GDP)確報値 [前年比]	-5.0%
	-			-	
	-			-	

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▲0.010%の出合から始まり、その後は主に▲0.030%～▲0.005%の水準で出合が見られた。週末3日積み要因が剥落したものの、引き続き地銀・大手行を中心にビッドサイドの調達意欲は強く、同加重平均金利(速報)は前営業日対比横這いの▲0.014%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.030 ~ ▲0.025	▲0.013 ~ ▲0.012	▲0.015 ~ ▲0.005

翌営業日のマーケット

ビッドサイドの動向に大きな変化はなく、引き続き堅調な地合が継続すると思われる。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	3月8日	3月9日	3月9日	3月10日	3月10日	3月11日
券	+300		+500		+0	
財政	+700		+6,700		▲29,000	
過不足		+1,000	+7,200		▲29,000	
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		+12,100				
共通担保(全店)					▲4,000	
CP等買入	▲100		▲100			
国債補完供給	+100	▲500	+500			
当座預金増減		+12,600	+7,600		▲33,000	
当座預金残高		4,835,700	4,843,300		4,810,300	
準備預金残高		4,294,800				
積み終了先		4,294,700				
超過準備		4,294,700				
非準備先残高		540,900				
準備預金進捗率		99.9%				
平均		75.0%				
乖離率		24.9%				

3月8日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
国債補完供給(3/8~3/9)	467	467	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マネタリーベース (億円)
3月5日時点 6,032,200

所要 (億円)
今積期の所要準備額 3,267,500
3月9日以降の残り所要
積数 100
平均 0

国庫短期証券入札予定

3月9日	6ヶ月	第978回
3月12日	3ヶ月	第979回
3月17日	1年	
3月18日	3ヶ月	

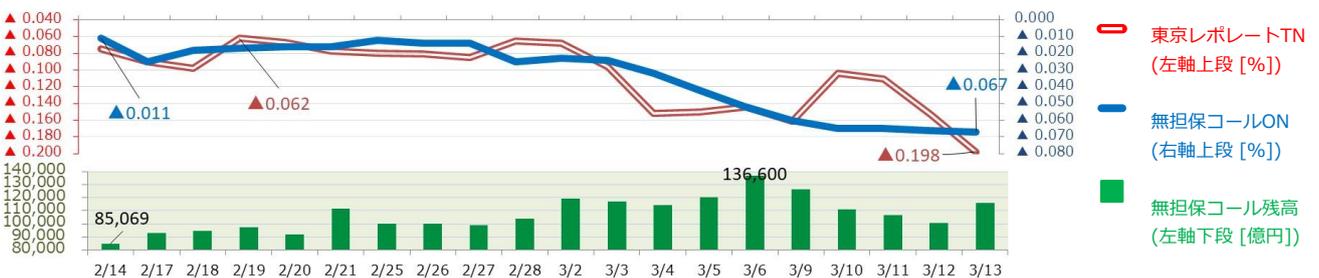
今月の国債買入オペ予定

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	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	3月5日	4
3年超5年以下	2,000~5,500	3,700	1 5 17 22 31	3月5日	3
5年超10年以下	2,500~6,000	4,200	5 12 17 22 26	3月5日	4
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
物価運動債	300	300	月2回程度	2月22日	2
変動利付債<償還月>	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