



短期市場の推移

[億円] [%]

	3月5日	3月8日	3月9日	3月10日
加重平均金利	▲0.014	▲0.014	▲0.013	▲0.013
東京レボレート(TN)	▲0.076	▲0.071	▲0.065	▲0.064
無コール残	120,859	116,037	104,418	117,628
ON	66,566	60,794	57,675	69,735
その他	54,293	55,243	46,743	47,893
有コール残	21,002	20,532	21,593	21,757

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 東京レボレート
	最低	最高	平均	
O/N	▲0.050	0.001	▲0.012	▲0.064
T/N	▲0.010	▲0.001	▲0.005	▲0.080
S/N	-	-	▲0.008	-
1W	-	-	▲0.009	▲0.082
2W	-	-	0.001	▲0.084
3W	-	-	-	▲0.101
1M	-	-	0.018	▲0.103
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.104
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12日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	(英)1月国内総生産 (GDP)	-
-	-	[前月比]	-
-	-	(欧)1月鉱工業生産指数	-
-	-	[前月比]	-
-	-	(米)2月生産者物価コア指数	2.5%
-	-	[前年比]	-

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▲0.008%の出合から始まり、その後は主に▲0.020%～▲0.005%の水準で出合が見られた。昨日同様地銀・大手行ともに調達意欲が強く、同加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.001%の▲0.012%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.020 ~ ▲0.015	▲0.012 ~ ▲0.012	▲0.010 ~ ▲0.005

翌営業日のマーケット

週末3日積みとなるためビッドサイドの調達意欲は強く、出合いの水準は本日対比で上昇と予想する。

資金需給

[億円]

	日銀速報 3月11日	日銀予想 3月12日	当社需給予想 3月15日
券	▲100	+100	+1,000
財政	+100	▲13,600	+1,000
過不足	+0	▲13,500	+2,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国庫短期証券買入			▲20,000
CP等買入	▲800	▲700	
社債等買入		+2,000	
E T F 買入	+100		
国債補充供給	+200	+200	
	▲200		
当座預金増減	▲700	+8,000	+2,000
当座預金残高	4,813,000	4,821,000	4,823,000
準備預金残高	4,270,000		
積み終了先	4,270,000		
超過準備	4,269,900		
非準備先残高	543,000		
準備預金進捗率	100.0%		
平均	85.7%		
乖離率	14.3%		

3月11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
国庫短期証券買入(3/12~)	20,000	40,537	20,005	0.001	0.002	18.2
国債補充供給(3/11~3/12)	241	241	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マネタリーベース [億円]
 3月10日時点 6,021,500

所要	[億円]
今積期の所要準備額	3,267,400
3月12日以降の残り所要	
積数	0
平均	0

国庫短期証券入札予定

3月12日	3ヶ月 第979回
3月17日	1年 第980回
3月18日	3ヶ月 第981回
3月24日	6ヶ月

国債入札予定

3月25日	40年
3月30日	2年
4月1日	10年
4月6日	30年

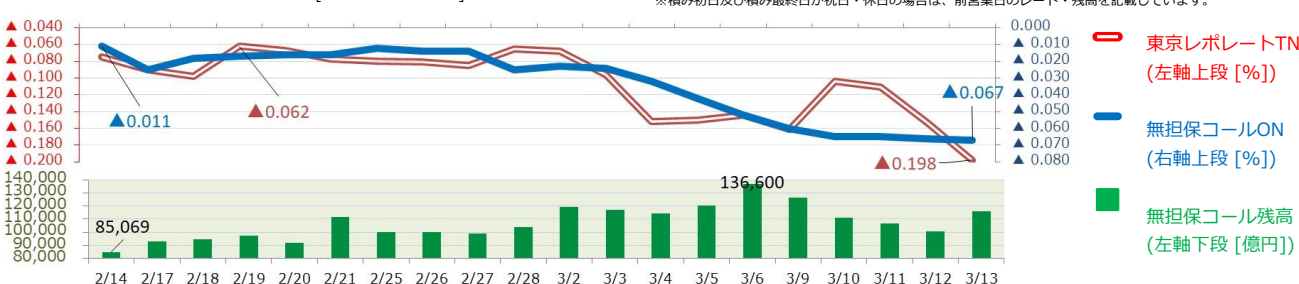
今月の国債買入オペ予定

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	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