



短期市場の推移

[億円] [%]

	3月8日	3月9日	3月10日	3月11日
加重平均金利	▲0.014	▲0.013	▲0.013	▲0.012
東京レポレート(TN)	▲0.071	▲0.065	▲0.064	▲0.080
無コール残	116,037	104,418	117,628	121,483
ON	60,794	57,675	69,735	74,190
その他	55,243	46,743	47,893	47,293
有コール残	20,532	21,593	21,757	21,339

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 東京レポレート
	最低	最高	平均	
O/N	▲0.060	0.001	▲0.013	▲0.056
T/N	-	-	▲0.001	▲0.054
S/N	-	-	▲0.008	-
1W	▲0.010	0.030	0.000	▲0.074
2W	-	-	▲0.020	▲0.082
3W	-	-	-	▲0.101
1M	-	-	▲0.015	▲0.103
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.104
6M	-	-	-	▲0.112
1Y	-	-	-	▲0.138

無担保コール(速報)は日銀、東京レポレートは日本証券業協会公表

3月15日の予定 (時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
8:50	BIS国際資金取引統計および国際 信統計の日本分集計結果 (2020年12月末現在)	-	(米)3月NY連銀製造業指数	
	-		-	
	-		-	

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▲0.009%の割合から始まり、その後は主に▲0.020%~▲0.005%の水準で出合が見られた。同加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.001%の▲0.013%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.030 ~ ▲0.015	▲0.011 ~ ▲0.011	▲0.020 ~ ▲0.005

翌営業日のマーケット

週末3日積み要因が剥落するため、出合水準は本日対比やや低下すると予想。

資金需給

[億円]

	日銀速報 3月12日	日銀予想 3月15日	当社需給予想 3月16日
券	+100	+600	+0
財政	▲14,400	+3,900	▲2,000
過不足	▲14,300	+4,500	▲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		
国債買入		+9,700	
CP等買入	▲700	▲1,200	
社債等買入	+2,000		
国債補完供給	+200	+900	
当座預金増減	+6,300	+13,900	▲2,000
当座預金残高	4,819,300	4,833,200	4,831,200
準備預金残高	4,269,800		
積み終了先	4,269,800		
超過準備	4,269,800		
非準備先残高	549,500		
準備預金進捗率	100.0%		
平均	96.4%		
乖離率	3.6%		

3月12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(3/15~)						
~1年	1,000	2,521	1,004	0.003	0.006	70.9
1~3年	4,000	8,009	4,003	▲0.010	▲0.004	11.6
5~10年	4,200	6,880	4,204	▲0.005	0.000	2.2
25年~	300	1,481	303	▲0.017	▲0.015	40.3
国債補完供給(3/12~3/15)						
	865	865	▲0.350	▲0.350		
	38	38	▲0.350	▲0.350		

マネタリーベース [億円]

3月11日時点 6,020,800

所要

今積期の所要準備額 3,267,400

3月15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17日	1年	第980回
3月18日	3ヶ月	第981回
3月24日	6ヶ月	
3月26日	3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

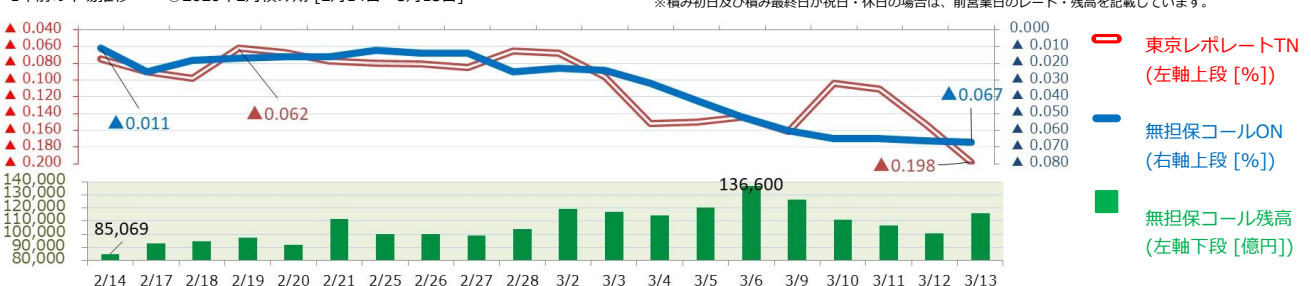
今月の国債買入オペ予定

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12日	0
1年超3年以下	2,500~5,500	4,000	5 12 17 22 26	3月12日	3
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12日	3
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	3月12日	1
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