



短期市場の推移

	3月9日	3月10日	3月11日	3月12日
加重平均金利	▲0.013	▲0.013	▲0.012	▲0.013
東京レボレート(TN)	▲0.065	▲0.064	▲0.080	▲0.054
無コール残	104,418	117,628	121,483	121,466
ON	57,675	69,735	74,190	66,403
その他	46,743	47,893	47,293	55,063
有コール残	21,593	21,757	21,339	20,736

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	▲0.050	0.001	▲0.016	▲0.067
T/N	▲0.010	▲0.001	▲0.002	▲0.081
S/N	-	-	▲0.010	-
1W	▲0.009	▲0.008	▲0.008	▲0.086
2W	▲0.015	▲0.010	▲0.011	▲0.088
3W	-	-	-	▲0.101
1M	-	-	0.000	▲0.104
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.106
6M	-	-	-	▲0.111
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

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	3月15日		3月16日		3月17日	
券	+700		+300		+0	
財政	+1,000		+2,900		▲1,000	
過不足	+1,700		+3,200		▲1,000	
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		+9,700				
CP等買入	▲1,200		▲300			
国債補完供給	+900	▲900	+900			
貸出増加支援					▲63,400	+64,500

3月15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

CP等買入(3/18~)
6,000 6,507 5,997 ▲0.045 ▲0.027 87.5

国債補完供給(3/15~3/16)

904 904 ▲0.350 ▲0.350
10 10 ▲0.350 ▲0.350

マネタリーベース [億円]

3月12日時点 6,027,100

所要

来積期の所要準備額 3,631,700

3月16日以降の残高 積数 3,631,700

平均 117,200

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

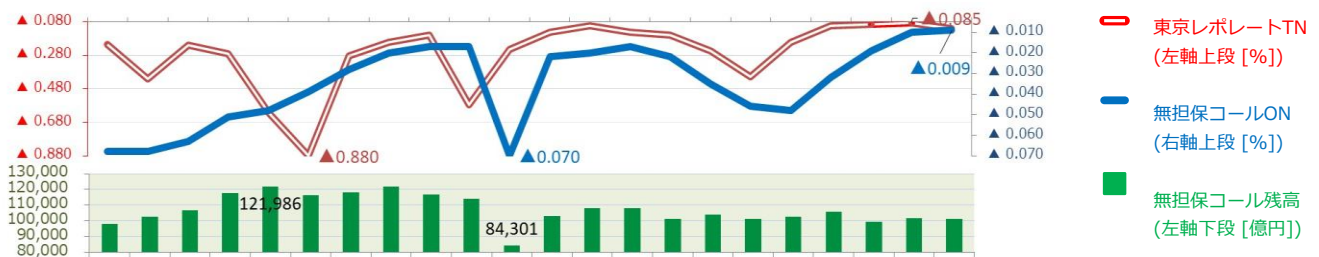
今日の国債買入オペ予定

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		
1年超3年以下	2,500~5,500	4,000	5 12 17 22 26	3月12日	0
3年超5年以下	2,000~5,500	3,700	1 5 17 22 31	3月12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		
変動利付債<偶数月>	500	500	月1回		
				2月22日	2
				2月22日	-

1年前の市場推移

○2020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