



デイリーシグナル

2021年3月22日(月)

短期市場の推移

	3月16日	3月17日	3月18日	3月19日
加重平均金利	▲0.019	▲0.018	▲0.014	▲0.010
東京レポレート(TN)	▲0.085	▲0.082	▲0.081	▲0.083
無コール残	129,036	118,800	118,470	123,497
ON	81,048	64,907	66,147	65,154
その他	47,988	53,893	52,323	58,343
有コール残	20,255	20,839	20,674	22,211

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
	最低	最高	平均	東京レポレート
O/N	▲0.060	0.001	▲0.014	▲0.076
T/N	▲0.010	▲0.001	▲0.004	▲0.087
S/N	-	-	▲0.010	-
1W	▲0.008	0.040	0.005	▲0.088
2W	-	-	-	▲0.101
3W	-	-	-	▲0.102
1M	-	-	-	▲0.103
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.105
6M	-	-	-	▲0.116
1Y	-	-	-	▲0.139

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23日の予定 (時刻は日本時間)

未定	日本	予想	海外	予想
		3月月例経済報告(内閣府)	-	16:00 (英)2月失業率
	-	-	21:30 (米)10-12月期経常収支	-1,840億米ドル
	-	-	23:00 (米)2月新築住宅販売件数	88.5万戸

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%の合出から始まり、その後は主に▲0.030%~▲0.003%の水準で合出が見られた。同加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.004%の▲0.014%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.030 ~ ▲0.023	▲0.020 ~ ▲0.020	▲0.025 ~ ▲0.003

翌営業日のマーケット

ビッドサイドの動向に変化はなく、出合水準は本日と横ばいを予想する。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	3月22日	3月23日	3月23日	3月24日	3月24日	3月24日
債券	▲200	▲100	▲100	▲100	▲100	+0
財政	+82,900	+700	+700	+1,900	+1,900	+1,900
過不足	+82,700	+600	+600	+1,900	+1,900	+1,900
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
国庫短期証券買入				+15,000		
国債買入				+12,300		
共通担保(全店)					▲3,600	
CP等買入	▲1,000		▲100			
E T F買入	+400		+200			
国債補充供給	+1,200	▲2,700	+2,700			
当座預金増減	+80,600	+30,700	+30,700	▲1,700	▲1,700	▲1,700
当座預金残高	4,966,300	4,997,000	4,997,000	4,995,300	4,995,300	4,995,300
準備預金残高	4,384,800	主な需給要因				
積み終了先	4,384,300					
超過準備	4,383,900					
非準備先残高	581,500					
準備預金進捗率	99.8%					
平均	22.6%					
乖離率	77.3%					

3月22日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分	
国庫短期証券買入(3/23~)	15,000	54,992	15,009	0.003	0.005	37.4	
国債買入(3/23~)	1~3年	4,000	8,181	4,002	▲0.012	▲0.011	91.6
	3~5年	3,700	7,704	3,705	▲0.023	▲0.021	68.4
	5~10年	4,200	10,559	4,201	▲0.036	▲0.031	35.9
物価連動	300	1,611	300	▲0.140	▲0.155		
社債等買入(3/25~)	750	1,618	750	0.008	0.019	47.3	
国債補充供給(3/22~3/23)	2,662	2,662	▲0.350	▲0.350			
	0	0					

マネタリーベース (億円)
3月19日時点 6,093,400

所要	今積期の所要準備額
3月23日以降の残り所要	3,631,700
積数	6,000
平均	300

国庫短期証券入札予定

3月24日	6ヶ月	第982回
3月26日	3ヶ月	第983回
4月2日	3ヶ月	
4月8日	6ヶ月	

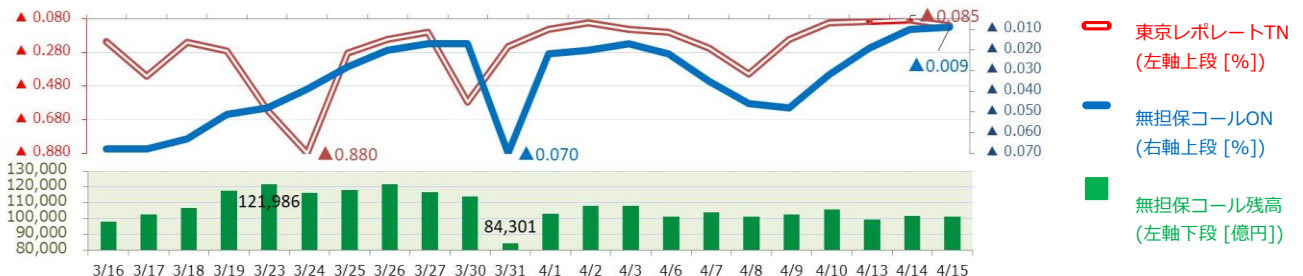
今月の国債買入オペ予定

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12日	0
1年超3年以下	2,500~5,500	4,000	5 12 17 22 26	3月22日	1
3年超5年以下	2,000~5,500	3,700	1 5 17 22 31	3月22日	1
5年超10年以下	2,500~6,000	4,200	5 12 17 22 26	3月22日	1
10年超25年以下	500~2,000	1,200	17 31	3月17日	1
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	3月22日	1
変動利付債<回数>	500	500	月1回	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