



短期市場の推移

[億円] [%]

	3月18日	3月19日	3月22日	3月23日
加重平均金利	▲0.014	▲0.010	▲0.014	▲0.014
東京レボレート(TN)	▲0.081	▲0.083	▲0.087	▲0.093
無コール残	118,470	123,497	134,987	135,810
ON	66,147	65,154	76,359	76,782
その他	52,323	58,343	58,628	59,028
有コール残	20,674	22,211	25,822	24,592

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	▲0.015	▲0.092
T/N	▲0.010	▲0.001	▲0.005	▲0.096
S/N	-	-	▲0.010	-
1W	▲0.020	0.001	▲0.005	▲0.106
2W	-	-	-	▲0.107
3W	-	-	-	▲0.106
1M	-	-	-	▲0.108
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.108
6M	-	-	-	▲0.117
1Y	-	-	-	▲0.139

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

[億円]

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想
	3月24日		3月25日		3月26日
券	▲500		▲1,400		▲1,000
財政	+100		+24,400		▲14,000
過不足	▲400		+23,000		▲15,000
金融調節	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド
共通担保(全店)	▲3,600	+4,900	▲600	+800	
CP等買入	▲700				
社債等買入					
国債補充供給	+2,500	▲2,400	+2,400		
新型コロナ対応金融支援特別			▲99,900	+186,700	
当座預金増減	+300		+112,400		▲15,000
当座預金残高	4,996,000		5,108,400		5,093,400
準備預金残高	4,392,000		4,391,900		4,391,900
積み終了先	4,391,900		4,391,900		4,391,900
超過準備	4,391,600		4,391,600		4,391,600
非準備先残高	604,000		604,000		604,000
準備預金進捗率	99.9%		99.9%		99.9%
平均	29.0%		29.0%		29.0%
乖離率	70.8%		70.8%		70.8%

国庫短期証券
発行・償還(6M)
年度末諸払い

3月24日のオペ結果

[%][億円]※ミ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
国債補充供給(3/24~3/25)	2,324	2,324	▲0.350	▲0.350		
	3	3	▲0.350	▲0.350		
新型コロナ対応金融支援特別(3/25~9/22)	186,686	186,686				

マネタリーベース [億円]
3月23日時点 6,203,900

所要	[億円]
今積期の所要準備額	3,631,700
3月25日以降の残り所要	
積数	5,200
平均	200

国庫短期証券入札予定

3月26日	3ヶ月	第983回
4月2日	3ヶ月	
4月8日	6ヶ月	
4月9日	3ヶ月	
3月25日	40年	
3月30日	2年	
4月1日	10年	
4月6日	30年	

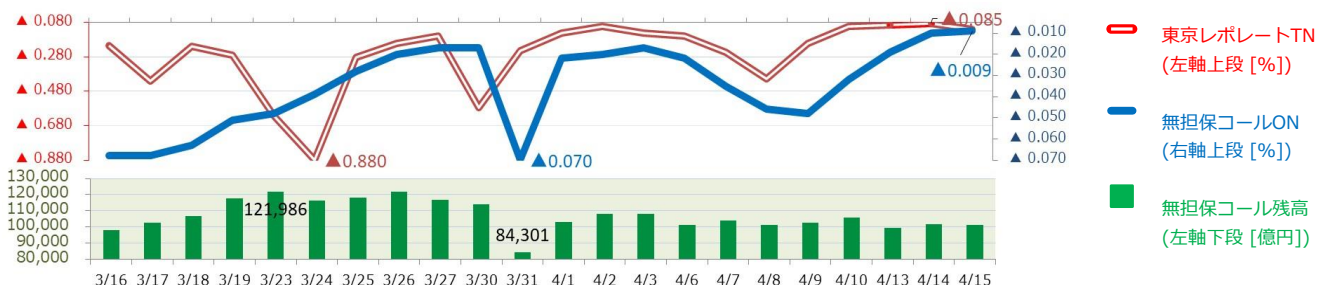
今月の国債買入オペ予定

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<偶数月>	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