



デイリーシグナル

2021年3月29日(月)

短期市場の推移

	3月23日	3月24日	3月25日	3月26日
加重平均金利	▲0.014	▲0.015	▲0.015	▲0.014
東京レポレート(TN)	▲0.093	▲0.096	▲0.099	▲0.092
無コール残	135,810	147,102	129,336	151,566
ON	76,782	85,329	72,973	93,428
その他	59,028	61,773	56,363	58,138
有コール残	24,592	25,864	26,668	26,918

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	▲0.050	0.001	▲0.014	▲0.085
T/N	▲0.009	▲0.001	▲0.004	▲0.090
S/N	▲0.150	▲0.010	▲0.091	-
1W	▲0.010	0.005	▲0.006	▲0.105
2W	-	-	-	▲0.104
3W	-	-	-	▲0.106
1M	-	-	-	▲0.107
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.108
6M	-	-	-	▲0.117
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30日の予定 (時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
8:30	2月有効求人倍率	1.10倍	23:00	(米)3月消費者信頼感指数	96.0
8:30	2月失業率	+3.0%	-	-	-
-	-	-	-	-	-

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%の出合から始まり、その後は主に▲0.025%~▲0.003%の水準で出合が見られた。同加重平均金利(速報)は前営業日対比横ばいの▲0.014%となった。なお、3月26日の無担保コール市場残高は2008年7月以来、約12年7か月ぶりの15兆円台であった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.030 ~ ▲0.025	▲0.018 ~ ▲0.018	▲0.015 ~ ▲0.002

翌営業日のマーケット

引き続き地銀業態の調達ニーズは強く、出合いの中心は横ばいからやや上昇と予想。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	3月29日	3月30日	3月29日	3月30日	3月31日	3月31日
債券	▲600			+500		▲800
財政	+31,200			+37,500		+31,800
過不足		+30,600		+38,000		+31,000
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		+8,900				
CP等買入	▲1,200		▲1,600			+4,000
国債補完供給	+700	▲1,300	+1,300			
当座預金増減		+37,700		+37,700		+35,000
当座預金残高		5,149,200		5,186,900		5,221,900
準備預金残高		4,557,500	主な需給要因			
積み終了先		4,556,300	年度末諸払い			
超過準備		4,556,300				
非準備先残高		591,700				
準備預金進捗率		99.9%				
平均		45.2%				
乖離率		54.7%				

3月29日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
国債補完供給(3/29~3/30)	1,292	1,292	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マネタリーベース (億円)
3月26日時点 6,322,300

所要	(億円)
今積期の所要準備額	3,631,700
3月30日以降の残り所要	
積数	2,900
平均	200

国債短期証券入札予定

入札日	3ヶ月	第984回
4月2日	3ヶ月	第984回
4月8日	6ヶ月	
4月9日	3ヶ月	
4月16日	3ヶ月	

国債入札予定

入札日	2年
3月30日	2年
4月1日	10年
4月6日	30年
4月8日	5年

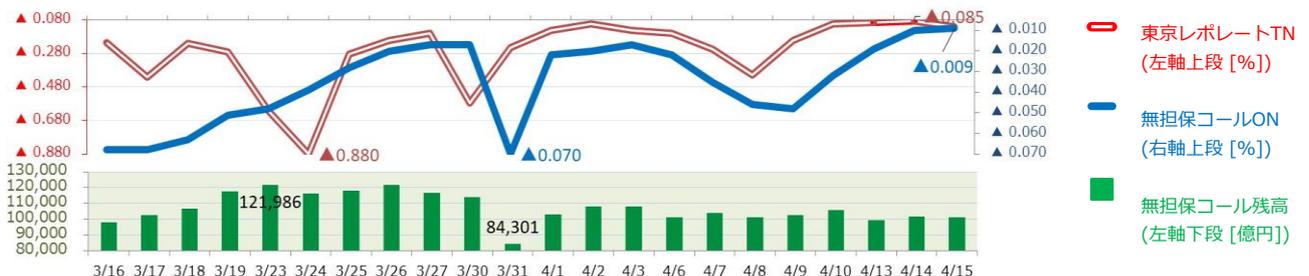
今月の国債買入オペ予定

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26日	0
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26日	0
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26日	0
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