



短期市場の推移

	2月24日	2月25日	2月28日	3月1日
加重平均金利	▲0.017	▲0.013	▲0.012	▲0.011
東京レボレート(TN)	▲0.087	▲0.089	▲0.087	▲0.087
無コール残	192,038	171,982	158,482	162,163
ON	114,307	74,661	73,619	86,660
その他	77,731	97,321	84,863	75,503
有コール残	28,181	28,233	26,688	28,156

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、無担保コール残高は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	▲0.080	0.001	▲0.010	▲0.085
T/N	-	-	-	▲0.086
S/N	-	-	▲0.005	-
1W	▲0.005	▲0.001	▲0.003	▲0.087
2W	▲0.045	▲0.001	▲0.027	▲0.088
3W	-	-	-	▲0.091
1M	-	-	-	▲0.100
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.101
6M	-	-	-	▲0.105
1Y	-	-	-	▲0.114

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

3月3日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	(米)パウエルFRB議長 上院銀行委員会 議会証言	-
-	-	(欧)ECB議事要旨 [2月会合]	-
-	-	19:00 (欧)1月失業率	7.0%

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▲0.004%の合出から始まり、その後は主に▲0.015%~▲0.003%のレンジで推移した。ビッドサイドの調達意欲は引き続き堅調で、本日の同加重平均金利(速報)は前営業日比+0.001%の▲0.010%(速報)となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.025 ~ ▲0.025	▲0.004 ~ ▲0.004	▲0.015 ~ ▲0.003

翌営業日のマーケット

オファービッドとともに大きな動向の変化はなく、出合の水準は本日対比横ばい圏を予想する。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想
	3月2日	3月3日	3月3日	3月4日	3月4日
券	▲300	▲1,100	▲1,100	▲1,000	▲1,000
財政	▲79,100	▲7,500	▲7,500	▲9,000	▲9,000
過不足	▲79,400	▲8,600	▲8,600	▲10,000	▲10,000
金融調節	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド
国庫短期証券買入		+5,000			
国債買入			+12,300		
共通担保(全店)	▲2,600	+2,600			
CP等買入			▲200		
社債等買入	▲100				
国債補完供給	+300				
成長基盤強化支援	▲3,400	+7,900			
当座預金増減	▲69,700	+3,500	+3,500	▲10,000	▲10,000
当座預金残高	5,295,000	5,298,500	5,298,500	5,288,500	5,288,500
準備預金残高	4,630,000				
積み終了先	4,629,700				
超過準備	4,629,600				
非準備先残高	665,000				
準備預金進捗率	99.9%				
平均	53.6%				
乖離率	46.3%				

3月2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(3/3~)						
~1年	1,500	6,034	1,500	▲0.013	▲0.006	14.3
1~3年	4,500	12,465	4,507	▲0.013	▲0.010	7.3
3~5年	4,500	8,535	4,506	▲0.027	▲0.025	99.6
10~25年	1,500	5,133	1,502	▲0.032	▲0.030	77.9
国債補完供給(3/2~3/3)						
	0	0				
	0	0				

マネタリーベース	【億円】
3月1日時点	6,607,400

所要	【億円】
今積期の所要準備額	3,404,800
3月3日以降の残り所要	
積数	400
平均	0

国庫短期証券入札予定

3月4日	3ヶ月(第1063回)
3月9日	6ヶ月(第1064回)
3月11日	3ヶ月
3月16日	1年
3月3日	30年
3月8日	5年
3月10日	20年
3月29日	40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	1500	1,500	月1回	3月2日	-
1年超3年以下	4500	4,500	2 9 16 23	3月2日	3
3年超5年以下	4500	4,500	2 9 23 30	3月2日	3
5年超10年以下	4250	4,250	9 16 23 30	2月24日	4
10年超25年以下	1500	1,500	2 9 16	3月2日	0
25年超	500	500	16	2月16日	1
物価連動債	600	600	月1回	2月24日	-
変動利付債<四半期>	300	300	四半期に1回	1月20日	-

1年前の市場推移

○2021年2月積み期 [2月16日~3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