



短期市場の推移

[億円] [%]

	2月25日	2月28日	3月1日	3月2日
加重平均金利	▲0.013	▲0.012	▲0.011	▲0.010
東京レポレート(TN)	▲0.089	▲0.087	▲0.087	▲0.086
無コール残	171,982	158,482	162,163	188,507
ON	74,661	73,619	86,660	107,084
その他	97,321	84,863	75,503	81,423
有コール残	28,233	26,688	28,156	27,826

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 東京レポレート
	最低	最高	平均	
O/N	▲0.080	0.001	▲0.009	▲0.084
T/N	-	-	-	▲0.085
S/N	-	-	▲0.005	-
1W	-	-	▲0.001	▲0.087
2W	▲0.001	0.050	0.008	▲0.088
3W	-	-	-	▲0.092
1M	-	-	-	▲0.100
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.101
6M	-	-	-	▲0.105
1Y	-	-	-	▲0.114

無担保コール(速報)は日銀、東京レポレートは日本証券業協会公表

3月4日の予定 (時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
8:30	1月有効求人倍率	1.16倍	22:30	(米)2月非農業部門雇用者数	40.0万人
8:30	1月失業率	+2.7%	22:30	(米)2月失業率	3.9%
-	-	-	22:30	(米)2月平均時給[前年比]	5.8%

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。昨日同様、ビッドサイドの調達ニーズは底堅く、本日の同加重平均金利(速報)は前営業日比+0.001%の▲0.009% (速報) となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.025 ~ ▲0.025	▲0.005 ~ ▲0.005	▲0.015 ~ ▲0.003

翌営業日のマーケット

週末3日積みのためビッドサイドの調達意欲が強く、出合の水準は本日対比上昇を予想する。

資金需給

[億円]

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	3月3日	3月4日	3月4日	3月7日	3月7日	3月7日
券	▲1,100	▲100	▲100	+1,000		
財政	▲8,900	▲1,300	▲1,300	▲12,000		
過不足	▲10,000	▲1,400	▲1,400	▲11,000		
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		+12,300				
CP等買入	▲200					
国債補完供給		▲300	+300			
当座預金増減	+1,800	▲1,100	▲1,100	▲11,000		
当座預金残高	5,296,800	5,295,700	5,295,700	5,284,700		
準備預金残高	4,621,800					
積み終了先	4,621,800					
超過準備	4,621,600					
非準備先残高	675,000					
準備預金進捗率	99.9%					
平均	57.1%					
乖離率	42.8%					

3月3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
国債補完供給(3/3~3/4)	275	275	▲0.350	▲0.350		
	12	12	▲0.350	▲0.350		

マネタリーベース [億円]
 3月2日時点 6,538,000

所要	[億円]
今積期の所要準備額	3,404,800
3月4日以降の残り所要	
積数	200
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

国債入札予定

3月8日	5年
3月10日	20年
3月29日	40年
3月31日	2年

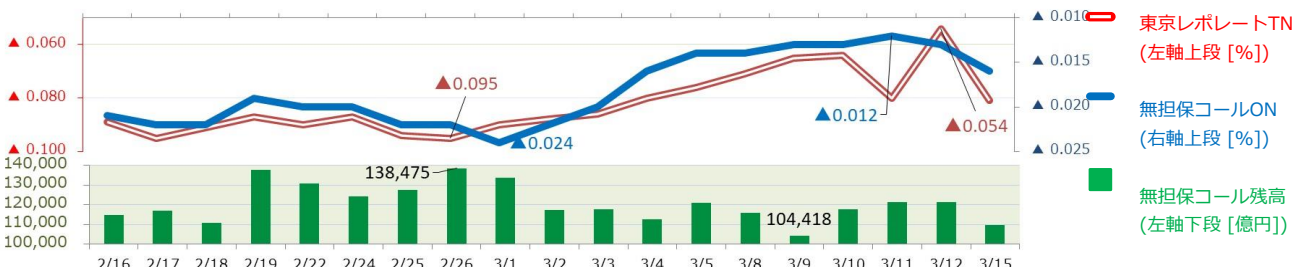
今月の国債買入オペ予定

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 23 30	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