



短期市場の推移

	2月28日	3月1日	3月2日	3月3日
加重平均金利	▲0.012	▲0.011	▲0.010	▲0.009
東京レポレート(TN)	▲0.087	▲0.087	▲0.086	▲0.085
無コール残	158,482	162,163	188,507	193,172
ON	73,619	86,660	107,084	109,144
その他	84,863	75,503	81,423	84,028
有コール残	26,688	28,156	27,826	27,894

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	▲0.065	0.001	▲0.009	▲0.085
T/N	-	-	-	▲0.083
S/N	-	-	▲0.005	-
1W	-	-	▲0.003	▲0.084
2W	-	-	▲0.003	▲0.087
3W	-	-	-	▲0.089
1M	-	-	0.030	▲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7日の予定 (時刻は日本時間)

15:00	日本	予想	海外	予想
		2月のコール市場残高(日銀)		特になし
	-		-	
	-		-	

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%の出合から始まり、その後は主に▲0.015%~▲0.003%のレンジで推移した。週末3日積みであったが調達ニーズはほぼ変わらず、本日の同加重平均金利(速報)も前営業日と横ばいの▲0.009% (速報) となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.025 ~ ▲0.020	▲0.005 ~ ▲0.005	▲0.010 ~ ▲0.003

翌営業日のマーケット

週明けも調達ニーズは変わらず、出合の水準は横ばいと予想する。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	3月4日		3月7日		3月8日	
券	▲100		+100		+1,000	
財政	▲2,000		▲12,800		+8,000	
過不足	▲2,100		▲12,700		+9,000	
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
CP等買入			▲300			
社債等買入			▲100			
国債補完供給	+300					
当座預金増減	▲1,800		▲13,100		+9,000	
当座預金残高	5,295,000		5,281,900		5,290,900	
準備預金残高	4,638,300		主な需給要因			
積み終了先	4,638,200		国庫短期証券発行・償還(3M)			
超過準備	4,638,200					
非準備先残高	656,700					
準備預金進捗率	99.9%					
平均	67.9%					
乖離率	32.0%					

3月4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
社債等買入(3/9~)	1,250	2,091	1,252	0.040	0.063	57.1
国債補完供給(3/4~3/7)	18	18	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マネタリーベース [億円]
3月3日時点 6,540,900

所要	[億円]
今積期の所要準備額	3,404,800
3月7日以降の残り所要	
積数	100
平均	0

国庫短期証券入札予定

3月9日	6ヶ月(第1064回)
3月11日	3ヶ月(第1065回)
3月16日	1年
3月17日	3ヶ月

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	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