



### 短期市場の推移

	3月2日	3月3日	3月4日	3月7日
加重平均金利	▲0.010	▲0.009	▲0.009	▲0.007
東京レボレート(TN)	▲0.086	▲0.085	▲0.083	▲0.077
無コール残	188,507	193,172	181,378	160,632
ON	107,084	109,144	97,490	79,844
その他	81,423	84,028	83,888	80,788
有コール残	27,826	27,894	27,939	28,085

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	▲0.060	0.001	▲0.007	▲0.078
T/N	-	-	-	▲0.083
S/N	-	-	▲0.004	-
1W	▲0.006	▲0.001	▲0.003	▲0.083
2W	-	-	-	▲0.086
3W	-	-	0.200	▲0.088
1M	-	-	-	▲0.099
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.101
6M	-	-	-	▲0.106
1Y	-	-	-	▲0.115

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9日の予定 (時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
8:50	10-12月期国内総生産(GDP)改定値[前期比年率]	+5.7%	(米) 週間のMBA	住宅ローン申請指数	
	-		-	-	
	-		-	-	

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

無担保コールON物は▲0.003%の合出から始まり、その後は主に▲0.005%~▲0.002%のレンジで推移した。本日もビッドサイドの調達ニーズは底堅く、同加重平均金利(速報)は前営業日比横ばいの▲0.007%(速報)となった。また日銀は1月6日以来、約二カ月振りとなる国債買現先オペをオファーした。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.020 ~ ▲0.015	▲0.003 ~ ▲0.003	▲0.005 ~ ▲0.001

### 翌営業日のマーケット

出合の水準は本日対比横ばい圏での推移を予想する。

### 資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	3月8日	3月9日	3月9日	3月10日	3月10日	3月11日
券		▲100		+300		▲1,000
財政		+3,200		▲8,100		▲2,000
過不足		+3,100		▲7,800		▲3,000
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
国庫短期証券買入				+5,000		
国債買現先				+30,300		▲30,000
CP等買入	▲100		▲200			
社債等買入			▲200		+1,300	
E T F 買入		+100				
国債補完供給		▲200	+200			
当座預金増減		+2,900		+28,600		▲33,000
当座預金残高		5,284,300		5,312,900		5,279,900
準備預金残高		4,631,800	主な需給要因			
積み終了先		4,631,700	国債発行(5年)		国庫短期証券発行・償還(6M)	
超過準備		4,631,700				
非準備先残高		652,500				
準備預金進捗率		99.9%				
平均		75.0%				
乖離率		24.9%				

### 3月8日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
国債買現先(3/9~3/10)	30,000	71,300	30,000	▲0.100	▲0.093	17.4
国庫短期証券買入(3/9~)	5,000	22,786	5,002	0.002	0.003	44.0
米ドル資金供給(3/10~3/17)	4	4	0.360	0.360		
国債補完供給(3/8~3/9)	128	128	▲0.350	▲0.350		
	9	9	▲0.350	▲0.350		

マネタリーベース 【億円】  
3月7日時点 6,525,500

所要	【億円】
今積期の所要準備額	3,406,600
3月9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
3月10日	20年
3月29日	40年
3月31日	2年
2月1日	10年

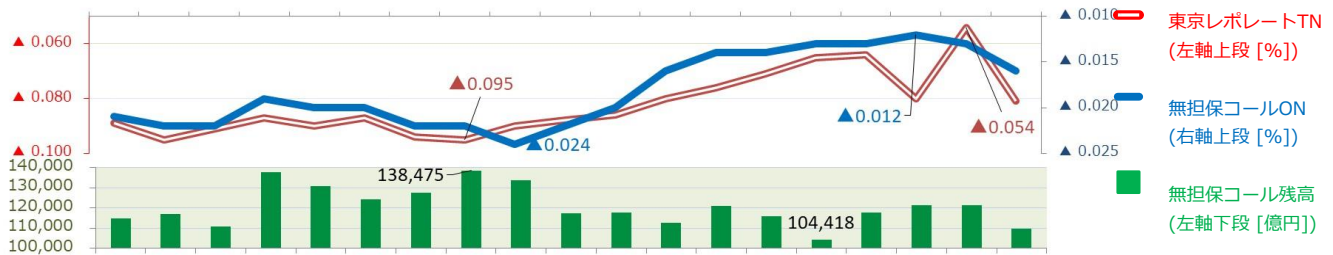
### 今月の国債買入オペ予定

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