



短期市場の推移

[億円] [%]

	3月7日	3月8日	3月9日	3月10日
加重平均金利	▲0.007	▲0.007	▲0.007	▲0.008
東京レポレート(TN)	▲0.077	▲0.083	▲0.086	▲0.086
無コール残	160,632	159,427	183,964	186,585
ON	79,844	82,084	104,831	101,432
その他	80,788	77,343	79,133	85,153
有コール残	28,085	28,909	28,386	28,567

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	▲0.060	0.001	▲0.010	▲0.082
T/N	-	-	-	▲0.085
S/N	-	-	▲0.005	-
1W	▲0.007	▲0.001	▲0.004	▲0.086
2W	-	-	-	▲0.088
3W	-	-	-	▲0.094
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14日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	19:00 (欧)1月鉱工業生産指数[前月比]	0.3%
-	-	-	-
-	-	-	-

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▲0.005%の出合から始まり、その後は主に▲0.015%～▲0.005%のレンジで推移した。積み最終日を来週に控える中、一部ビッドサイドで調達意欲の弱まりが見られ同加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.002%の▲0.010%(速報)となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.025 ~ ▲0.020	▲0.008 ~ ▲0.008	▲0.020 ~ ▲0.001

翌営業日のマーケット

ビッドサイドの調達意欲の弱まりから、出合の水準は本日対比若干の低下を予想する。

資金需給

[億円]

	日銀速報	日銀予想	当社需給予想
	3月11日	3月14日	3月15日
券	+0	+400	+0
財政	▲9,700	+4,600	+3,000
過不足	▲9,700	+5,000	+3,000
金融調節	エンド	エンド	エンド
CP等買入	▲300	▲400	▲400
国債補完供給	▲100	+100	-
当座預金増減	▲10,100	+4,700	+3,000
当座預金残高	5,319,900	5,324,600	5,327,600
準備預金残高	4,655,700	4,655,600	4,655,600
積み終了先	4,655,600	4,655,600	4,655,600
超過準備	4,655,600	4,655,600	4,655,600
非準備先残高	664,200	664,200	664,200
準備預金進捗率	100.0%	100.0%	100.0%
平均	92.9%	92.9%	92.9%
乖離率	7.1%	7.1%	7.1%

3月11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
------	------	----	----	----	----	----

CP等買入(3/16~)

5,000 12,943 4,998 ▲0.030 ▲0.027 80.3

国債補完供給(3/11~3/14)

53 53 ▲0.350 ▲0.350
0 0

マネタリーベース [億円]

3月10日時点 6,574,700

所要

[億円]

今積期の所要準備額 3,406,600

3月14日以降の残り所要

積数 0

平均 0

国庫短期証券入札予定

3月16日	1年 (第1066回)
3月17日	3ヶ月 (第1067回)
3月24日	6ヶ月
3月25日	3ヶ月

国債入札予定

3月29日	40年
3月31日	2年
2月1日	10年
2月3日	30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	0
1年超3年以下	4500	4,500	2 9 16 23	3月9日	2
3年超5年以下	4500	4,500	2 9 23 30	3月2日	2
5年超10年以下	4250	4,250	9 16 23 30	3月9日	3
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	1
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