



短期市場の推移

[億円] [%]

	3月9日	3月10日	3月11日	3月14日
加重平均金利	▲0.007	▲0.008	▲0.010	▲0.011
東京レボレート(TN)	▲0.086	▲0.086	▲0.085	▲0.085
無コール残	183,964	186,585	180,137	150,735
ON	104,831	101,432	101,149	79,172
その他	79,133	85,153	78,988	71,563
有コール残	28,386	28,567	29,081	29,040

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	▲0.055	0.001	▲0.008	▲0.088
T/N	-	-	▲0.010	▲0.085
S/N	-	-	▲0.005	-
1W	▲0.020	▲0.001	▲0.007	▲0.085
2W	▲0.040	▲0.037	▲0.038	▲0.087
3W	-	-	-	▲0.097
1M	▲0.009	0.010	0.000	▲0.099
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.101
6M	-	-	-	▲0.104
1Y	-	-	-	▲0.112

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

資金需給

[億円]

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	3月15日		3月16日		3月17日	
券	+300		▲600		▲1,000	
財政	+2,900		▲3,400		+3,000	
過不足	+3,200		▲4,000		+2,000	
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				+10,000		
国債買現先			▲40,700			
共通担保(全店)			▲2,600	+4,300		
CP等買入	▲800		▲100	+5,000		
国債補充供給	+100					
貸出増加支援			▲22,500	+38,900		
当座預金増減	+2,500		▲11,700		+2,000	
当座預金残高	5,327,500		5,315,800		5,317,800	
準備預金残高	4,685,800		4,685,800		4,685,800	
積み終了先	4,685,800		4,685,800		4,685,800	
超過準備	4,685,800		4,685,800		4,685,800	
非準備先残高	641,700		641,700		641,700	
準備預金進捗率	100.0%		100.0%		100.0%	
平均	100.0%		100.0%		100.0%	
乖離率	0.0%		0.0%		0.0%	

3月15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
国債補充供給(3/15~3/16)	0	0	0	0		
共通担保(全店)(3/16~3/30)	20,000	4,251	4,251			
国庫短期証券買入(3/16~)	10,000	37,607	10,000	0.006	0.006	

マネタリーベース [億円]
 3月14日時点 6,569,300

所要	[億円]
来積期の所要準備額	3,775,500
3月16日以降の残り所要	
積数	3,775,500
平均	121,800

国庫短期証券入札予定

今月の国債買入オペ予定

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

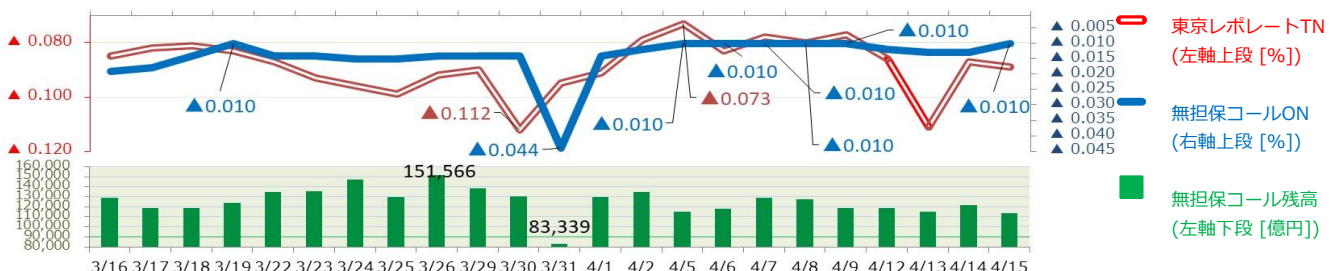
3月29日	40年
3月31日	2年
2月1日	10年
2月3日	30年

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3月積み期 [3月16日~4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(登金)第 243号 加入協会 日本証券業協会