



短期市場の推移

	3月10日	3月11日	3月14日	3月15日
加重平均金利	▲0.008	▲0.010	▲0.011	▲0.008
東京レポレート(TN)	▲0.086	▲0.085	▲0.085	▲0.085
無コール残	186,585	180,137	150,735	132,593
ON	101,432	101,149	79,172	61,200
その他	85,153	78,988	71,563	71,393
有コール残	28,567	29,081	29,040	27,481

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

3月17日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
日銀金融政策決定会合 (1日目)		(米)3月連邦公開市場委員会 (FOMC)政策金利	0.50%

経済指標及び予想値は株式会社フィスコ提供

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	▲0.013	▲0.085
T/N	-	-	▲0.005	▲0.085
S/N	-	-	▲0.005	-
1W	▲0.005	▲0.003	▲0.004	▲0.085
2W	-	-	▲0.005	▲0.086
3W	-	-	-	▲0.096
1M	0.001	0.100	0.024	▲0.099
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.100
6M	-	-	-	▲0.103
1Y	-	-	-	▲0.111

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

本日の市況

無担保コールON物は▲0.010%の出合から始まり、その後は主に▲0.010%~▲0.001%のレンジで推移した。新積み期に入り様子見る金融機関も散見され、同加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.005%の▲0.013%(速報)となった。

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

翌営業日のマーケット

様子見していた金融機関が調達を開始し、本日対比で出合いの水準は上昇すると予想。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	3月16日	3月17日	3月17日	3月18日	3月18日	3月19日
券	▲600	▲1,000	▲1,000	▲2,000	▲2,000	▲11,000
財政	▲3,700	+1,000	+1,000	+11,000	+11,000	+11,000
過不足	▲4,300	+0	+0	+9,000	+9,000	+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
国庫短期証券買入		+10,000				
国債買入				+13,800		
国債買現先	▲40,700					
共通担保(全店)	▲2,600	+4,300				
CP等買入	▲100	+5,000	▲300			
国債補充供給		▲100	+100			
貸出増加支援	▲22,500	+38,900				
当座預金増減	▲12,100	+13,600	+13,600	+9,000	+9,000	+9,000
当座預金残高	5,315,400	5,329,000	5,329,000	5,338,000	5,338,000	5,338,000
準備預金残高	4,666,700					
積み終了先	3,517,400					
超過準備	1,390,900					
非準備先残高	648,700					
準備預金進捗率	86.8%					
平均	3.2%					
乖離率	83.5%					

3月16日のオペ結果

オベ種類 オファー 応札 落札 足切 平均 按分

国債買入(3/17~)	1~3年	4,500	10,666	4,505	▲0.003	▲0.001	16.3
3~5年	4,500	8,337	4,512	▲0.008	▲0.007	43.5	
5~10年	4,250	6,750	4,254	▲0.010	▲0.008	85.7	
25年~	500	1,705	502	▲0.012	▲0.010	37.2	

国債補充供給(3/16~3/17)

51	51	▲0.350	▲0.350
0	0		

マネタリーベース (億円)
 3月15日時点 6,571,400

所要	今積期の所要準備額	3月17日以降の残り所要
積数	3,775,500	499,700
平均		16,700

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

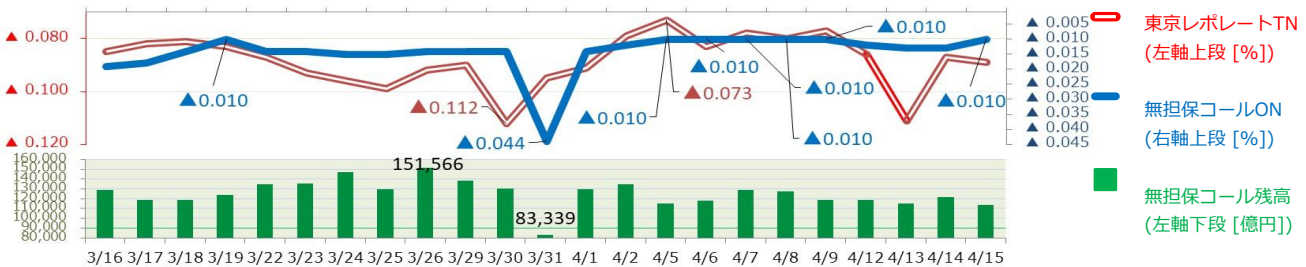
今月の国債買入オペ予定

オベ種類	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16日	1
3年超5年以下	4500	4,500	2 9 23 30	3月16日	2
5年超10年以下	4250	4,250	9 16 23 30	3月16日	2
10年超25年以下	1500	1,500	2	3月2日	0
25年超	500	500	16	3月16日	0
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 近畿財務局長(登金)第243号 加入協会 日本証券業協会