



短期市場の推移

	3月15日	3月16日	3月17日	3月18日
加重平均金利	▲0.008	▲0.013	▲0.009	▲0.006
東京レポレート(TN)	▲0.085	▲0.085	▲0.085	▲0.083
無コール残	132,593	170,082	180,621	189,508
ON	61,200	86,924	90,658	101,680
その他	71,393	83,158	89,963	87,828
有コール残	27,481	27,727	28,257	28,968

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	▲0.005	▲0.084
T/N	-	-	-	▲0.085
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.020	▲0.001	▲0.006	▲0.085
2W	0.010	0.150	0.080	▲0.093
3W	-	-	-	▲0.094
1M	-	-	-	▲0.097
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.099
6M	-	-	-	▲0.104
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

3月23日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	欧	ラガルドECB総裁の講演
-	-	-	-
-	-	-	-

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%の出合から始まり、その後は主に▲0.008%~▲0.001%のレンジで推移した。週末要因が剥落したが、引き続きビッドサイドの調達ニーズは強く、同加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.001%の▲0.005%と2016年4月14日以来の水準となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.010 ~ ▲0.010	▲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22日	3月23日	3月23日	3月24日	3月24日
券	+100	▲400	▲400	▲1,000	▲1,000
財政	+60,200	+5,600	+5,600	+3,000	+3,000
過不足	+60,300	+5,200	+5,200	+2,000	+2,000
金融調節	エンド	スタート	エンド	スタート	スタート
国庫短期証券買入			+20,000		
CP等買入	▲600	▲300	▲300		
国債補完供給	+200	+200	+200		
当座預金増減	+59,700	+25,100	+25,100	+2,000	+2,000
当座預金残高	5,399,800	5,424,900	5,424,900	5,426,900	5,426,900
準備預金残高	4,744,200	主な需給要因			
積み終了先	4,744,000				
超過準備	4,744,000				
非準備先残高	655,600				
準備預金進捗率	99.8%				
平均	22.6%				
乖離率	77.3%				

3月22日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
国庫短期証券買入(3/23~)	20,000	67,444	20,003	0.003	0.004	12.7
米ドル資金供給(3/24~3/31)	0	0	0.580	0.580		
国債補完供給(3/22~3/23)	215	215	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マネタリーベース (億円)
3月18日時点 6,586,300

所要	(億円)
今積期の所要準備額	3,775,500
3月23日以降の残り所要	
積数	6,300
平均	300

国庫短期証券入札予定

3月24日	6ヶ月(第1068回)
3月25日	3ヶ月(第1069回)
2月4日	3ヶ月
2月9日	6ヶ月

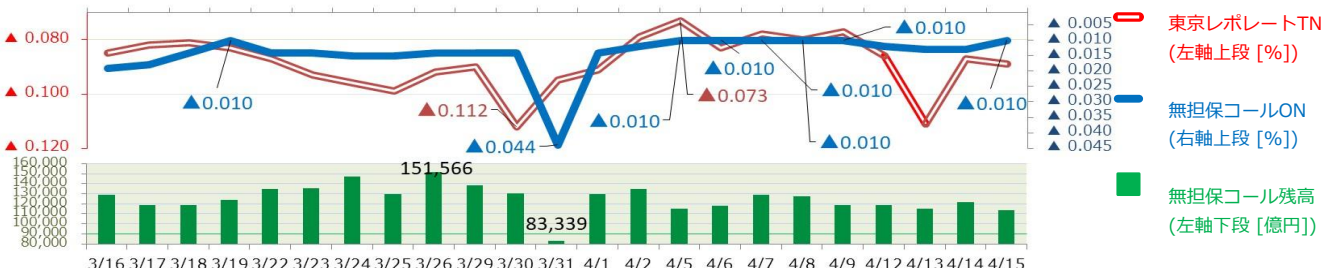
今月の国債買入オペ予定

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 16	3月2日	0
25年超	500	500		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