



短期市場の推移

	3月16日	3月17日	3月18日	3月22日
加重平均金利	▲0.013	▲0.009	▲0.006	▲0.005
東京レポレート(TN)	▲0.085	▲0.085	▲0.083	▲0.085
無コール残	170,082	180,621	189,508	181,534
ON	86,924	90,658	101,680	95,701
その他	83,158	89,963	87,828	85,833
有コール残	27,727	28,257	28,968	29,258

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	▲0.006	▲0.084
T/N	-	-	-	▲0.085
S/N	-	-	▲0.003	-
1W	▲0.005	0.001	0.000	▲0.085
2W	-	-	-	▲0.092
3W	-	-	-	▲0.094
1M	-	-	-	▲0.097
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.098
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24日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	21:30 (米)2月耐久財受注[前月比]	-0.6%
-	-	21:30 (米)10-12月期経常収支	-2176億米ドル
-	-	21:30 (米)新規失業保険申請件数[前週分]	-

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。昨日同様ビッドサイドの調達意欲は強く、同加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.001%の▲0.006%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.010 ~ ▲0.008	▲0.003 ~ ▲0.003	▲0.005 ~ ▲0.001

翌営業日のマーケット

出合の水準は本日同様、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23日		3月24日		3月25日	
券	▲300		▲1,200		▲1,000	
財政	+1,800		+14,600		+40,000	
過不足	+1,500		+13,400		+39,000	
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		+20,000				
国債買入				+13,400		
CP等買入	▲300		▲400			
国債補充供給	+200	▲100	+100			
当座預金増減	+21,300		+26,500		+39,000	
当座預金残高	5,421,100		5,447,600		5,486,600	
準備預金残高	4,775,300		主な需給要因			
積み終了先	4,775,100		年度末融資			
超過準備	4,775,100		流動性供給			
非準備先残高	645,800					
準備預金進捗率	99.8%					
平均	25.8%					
乖離率	74.0%					

3月23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
国債買入(3/24~)						
1~3年	4,500	8,759	4,502	▲0.007	▲0.004	9.3
3~5年	4,500	9,522	4,509	▲0.002	▲0.001	58.8
5~10年	4,250	10,647	4,256	0.003	0.004	80.2
社債等買入(3/28~)						
	750	2,099	750	0.223	0.272	14.7
国債補充供給(3/23~3/24)						
	70	70	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マネタリーベース (億円)
 3月22日時点 6,645,900

所要	(億円)
今積期の所要準備額	3,775,500
3月24日以降の残り所要	
積数	6,000
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

国債入札予定

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