



短期市場の推移

	3月18日	3月22日	3月23日	3月24日
加重平均金利	▲0.006	▲0.005	▲0.006	▲0.005
東京レポレート(TN)	▲0.083	▲0.085	▲0.085	▲0.089
無コール残	189,508	181,534	199,522	195,279
ON	101,680	95,701	110,119	102,996
その他	87,828	85,833	89,403	92,283
有コール残	28,968	29,258	29,544	29,173

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28日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	-	-
-	-	-	-
-	-	-	-

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	▲0.050	0.001	▲0.004	▲0.087
T/N	-	-	-	▲0.088
S/N	-	-	▲0.003	-
1W	-	-	0.001	▲0.092
2W	-	-	-	▲0.093
3W	-	-	▲0.003	▲0.095
1M	-	-	0.480	▲0.098
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

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。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▲0.004%と2016年3月31日以来の約6年ぶりの高水準となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.008 ~ ▲0.007	▲0.002 ~ ▲0.002	▲0.005 ~ ▲0.001

翌営業日のマーケット

週末週末3日積み要因剥落も、ビッドサイドの調達意欲は引き続き強いことが見込まれるため、出合の水準は本日対比で若干の低下にとどまると予想する。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	3月25日		3月28日		3月29日	
券	▲300		+100		+1,000	
財政	+33,000		+6,600		+6,000	
過不足	+32,700		+6,700		+7,000	
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
CP等買入	▲600	-	▲200	-	-	-
社債等買入	-	-	-	+800	-	-
国債補完供給	+300	▲300	+300	-	-	-
新型コロナ対応金融支援特別	-	-	▲241,800	+287,700	-	-
当座預金増減	+32,100		+53,500		+7,000	
当座預金残高	5,479,100		5,532,600		5,539,600	
準備預金残高	4,829,100		-		-	
積み終了先	4,829,000		-		-	
超過準備	4,829,000		-		-	
非準備先残高	650,000		-		-	
準備預金進捗率	99.9%		-		-	
平均	38.7%		-		-	
乖離率	61.1%		-		-	

3月25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
国債補完供給(3/25~3/28)	183	183	▲0.350	▲0.350	-	-
新型コロナ対応金融支援特別(3/28~9/28)	73	73	▲0.350	▲0.350	-	-
	287,713	287,713	-	-	-	-

マネタリーベース [億円]
3月24日時点 6,694,600

所要	今積期の所要準備額
3月28日以降の残り所要	3,775,500
積数	5,600
平均	300

国債短期証券入札予定

4月1日	3ヶ月(第1070回)
4月7日	6ヶ月
4月8日	3ヶ月
4月15日	3ヶ月

国債入札予定

3月29日	40年
3月31日	2年
4月5日	10年
4月7日	30年

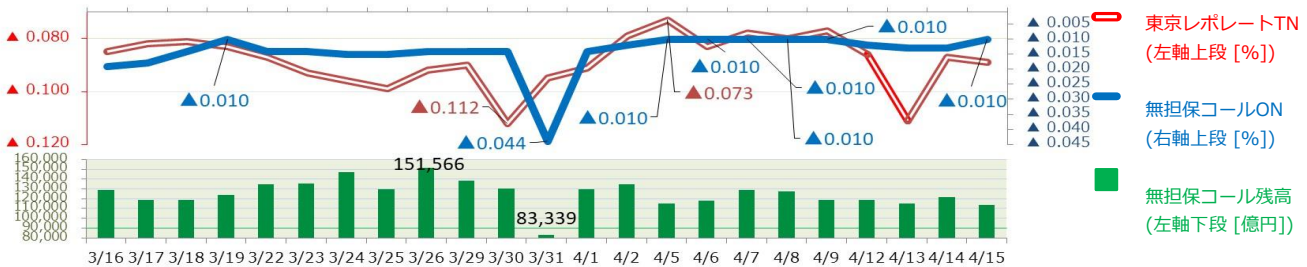
今月の国債買入オペ予定

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