



短期市場の推移

	3月22日	3月23日	3月24日	3月25日
加重平均金利	▲0.005	▲0.006	▲0.005	▲0.004
東京レボレート(TN)	▲0.085	▲0.085	▲0.089	▲0.088
無コール残	181,534	199,522	195,279	203,577
ON	95,701	110,119	102,996	106,164
その他	85,833	89,403	92,283	97,413
有コール残	29,258	29,544	29,173	30,127

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	▲0.050	0.001	▲0.004	▲0.092
T/N	-	-	-	▲0.091
S/N	-	-	▲0.003	-
1W	-	-	-	▲0.094
2W	-	-	-	▲0.094
3W	0.001	0.010	0.006	▲0.096
1M	-	-	▲0.001	▲0.099
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.099
6M	-	-	-	▲0.103
1Y	-	-	-	▲0.109

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

3月29日の予定 (時刻は日本時間)

時刻	日本	予想	海外	
				予想
8:30	2月有効求人倍率	1.20倍	23:00	(米)3月消費者信頼感指数 107.8
8:30	2月失業率	+2.8%	-	-
8:50	日銀金融政策決定会合における主な意見 (3月17日~3月18日)	-	-	-

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%の水準で取引された。ビッドサイドの調達意欲は前営業日と変わらず強く、同加重平均金利(速報)は前営業日対比横ばいの▲0.004%となった。なお前営業日の無担保コール市場残高は203,577億円と2001年1月以来約11年2か月ぶりの大きさまで増加した。

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

ビッドサイドの調達意欲はの強さは変わらず、出合の水準は本日対比横ばいと予想する。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	3月28日	3月29日	3月28日	3月29日	3月28日	3月29日
券						
財政	+3,900	+14,100	+3,900	+14,100	+14,000	+14,000
過不足						
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
国債買入						
CP等買入	▲200		▲400			
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	+50,400	+13,900	+50,400	+13,900	+14,000	+14,000
当座預金残高	5,529,500	5,543,400	5,529,500	5,543,400	5,557,400	5,557,400
準備預金残高	4,868,300		4,868,300			
積み終了先	4,867,900		4,867,900			
超過準備	4,867,900		4,867,900			
非準備先残高	661,200		661,200			
準備預金進捗率	99.9%		99.9%			
平均	41.9%		41.9%			
乖離率	57.9%		57.9%			

3月28日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
CP等買入(3/31~)	5,000	12,287	4,995	▲0.013	▲0.010	
国債補完供給(3/28~3/29)	260	260	▲0.350	▲0.350		
	25	25	▲0.350	▲0.350		
国債買入(固定利回り方式)(残存5年超10年以下)(3/29~)	0	0				
	645	645				

マネタリーベース (億円)
 3月25日時点 6,726,900

所要	今積期の所要準備額
3月29日以降の残り所要	3,775,500
積数	5,200
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

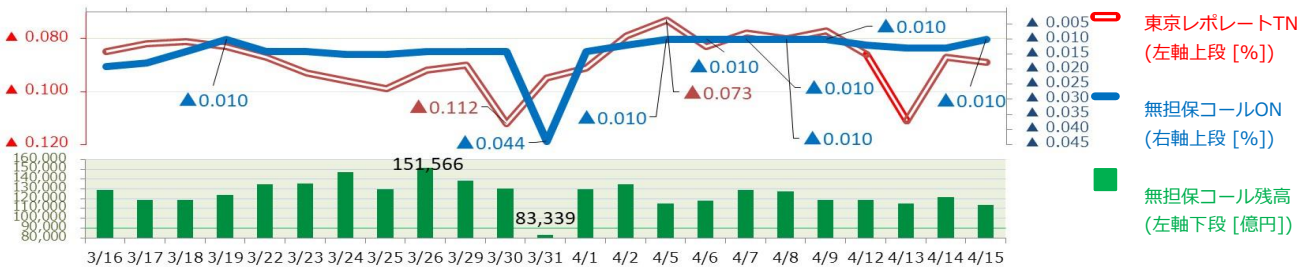
今月の国債買入オペ予定

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