



短期市場の推移

	3月23日	3月24日	3月25日	3月28日
加重平均金利	▲0.006	▲0.005	▲0.004	▲0.004
東京レボレート(TN)	▲0.085	▲0.089	▲0.088	▲0.091
無コール残	199,522	195,279	203,577	187,893
ON	110,119	102,996	106,164	90,945
その他	89,403	92,283	97,413	96,948
有コール残	29,544	29,173	30,127	29,440

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	▲0.100
T/N	▲0.003	▲0.001	▲0.002	▲0.103
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.020	0.001	▲0.007	▲0.103
2W	-	-	▲0.025	▲0.103
3W	-	-	-	▲0.101
1M	-	-	▲0.013	▲0.102
2M	-	-	-	-
3M	-	-	0.005	▲0.100
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30日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	21:15 (米)3月ADP全米雇用報告	40.0万人
-	-	21:30 (米)10-12月期国内総生産(GDP) 確定値[前期比年率]	7.1%
-	-	-	-

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。本日も地銀業態を中心に積極的な調達が見られ、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。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.008 ~ ▲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29日		3月30日		3月31日
券	▲700		▲200		+600
財政	+11,100		+12,900		+34,400
過不足	+10,400		+12,700		+35,000
金融調節	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド
国庫短期証券買入				+20,000	
国債買入		+600		+5,200	
共通担保(全店)			▲4,300	+5,100	
CP等買入	▲400		▲300		+5,000
E T F 買入				+100	
国債補完供給	+300	▲100	+100		
当座預金増減	+10,800		+38,600		+40,000
当座預金残高	5,540,300		5,578,900		5,618,900
準備預金残高	4,887,500		4,886,800		4,886,800
積み終了先	4,886,800		年度末諸払い		年度末諸払い
超過準備	4,886,800		国債発行(40年)		
非準備先残高	652,800				
準備預金進捗率	99.9%				
平均	45.2%				
乖離率	54.7%				

3月29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(3/30~)	20,000	26,468	20,005	▲0.005	0.000	26.4
米ドル資金供給(3/31~4/7)	0	0	0.590	0.590		
国債補完供給(3/29~3/30)	90	90	▲0.350	▲0.350		
共通担保(全店)(3/30~4/13)	20,000	5,101	5,101			
国債買入(固定利回り方式)(残存5年超10年以下)(3/30~)	2426	2426				
	2860	2860				

マネタリーベース [億円]
 3月28日時点 6,777,400

所要	[億円]
今積期の所要準備額	3,775,500
3月30日以降の残り所要	
積数	4,400
平均	300

国庫短期証券入札予定

4月1日	3ヶ月
4月7日	6ヶ月
4月8日	3ヶ月
4月15日	1年
3月31日	2年
4月5日	10年
4月7日	30年
4月12日	5年

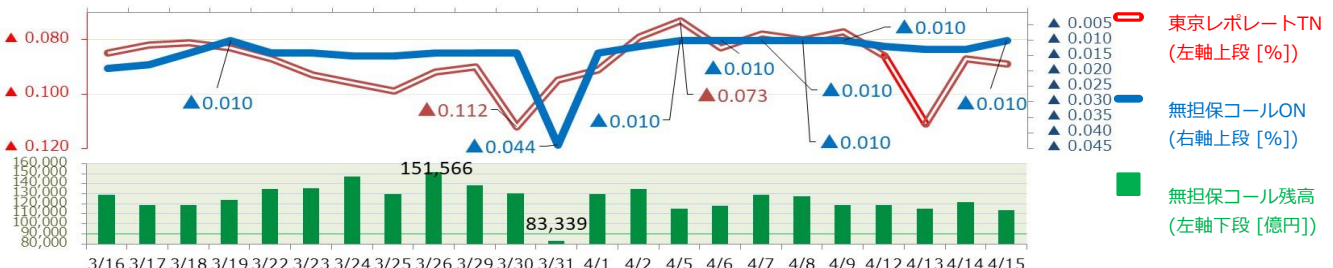
今月の国債買入オペ予定

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 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