



短期市場の推移

[億円] [%]

	3月3日	3月4日	3月5日	3月6日
加重平均金利	0.477	0.476	0.476	0.476
東京レボレート(TN)	0.477	0.486	0.480	0.462
無コール残	93,659	85,194	86,409	87,741
ON	43,335	33,890	34,350	35,682
その他	50,324	51,304	52,059	52,059
有コール残	37,424	35,965	36,135	34,932

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	0.450	0.500	0.477	0.483
T/N	-	-	-	0.482
S/N	-	-	-	-
1W	0.485	0.530	0.518	0.450
2W	0.550	0.580	0.565	0.443
3W	-	-	-	0.442
1M	0.600	0.670	0.647	0.436
2M	-	-	-	-
3M	-	-	0.630	0.457
6M	-	-	-	0.497
1Y	-	-	-	0.595

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

資金需給

[億円]

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	3月7日	3月10日	3月10日	3月11日	3月11日	3月11日
券	+1,100	+500	+500	+1,000	+1,000	+1,000
財政	▲7,400	+9,600	+9,600	▲29,000	▲29,000	▲29,000
過不足	▲6,300	+10,100	+10,100	▲28,000	▲28,000	▲28,000
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	▲500	▲100	▲100			
社債等買入	▲100					
国債補完供給	+3,300	▲4,900	+4,900			
当座預金増減	▲8,500	+14,900	+14,900	▲28,000	▲28,000	▲28,000
当座預金残高	5,195,600	5,210,500	5,210,500	5,182,500	5,182,500	5,182,500
準備預金残高	4,716,700	4,716,600	4,716,600	4,716,600	4,716,600	4,716,600
積み終了先	4,716,600	4,716,600	4,716,600	4,716,600	4,716,600	4,716,600
超過準備	4,716,600	4,716,600	4,716,600	4,716,600	4,716,600	4,716,600
非準備先残高	478,900	478,900	478,900	478,900	478,900	478,900
準備預金進捗率	99.9%	99.9%	99.9%	99.9%	99.9%	99.9%
平均	78.6%	78.6%	78.6%	78.6%	78.6%	78.6%
乖離率	21.3%	21.3%	21.3%	21.3%	21.3%	21.3%

国庫短期証券入札予定

3月14日	3ヶ月(第1293回)
3月18日	1年
3月21日	3ヶ月
3月28日	3ヶ月
国債入札予定	
3月10日	5年
3月12日	20年
3月27日	40年
3月31日	2年

今月の国債買入オペ予定

オペ種類	一回当たりオペファー金額	直近オペファー額	直近日	残り回数
1年以下	1500	1,500	5	0
1年超3年以下	3000	3,000	5 11 17 24	3
3年超5年以下	3000	3,000	5 17 24 28	3
5年超10年以下	3250	3,250	11 17 24 28	4
10年超25年以下	1500	1,500	5 17 28	2
25年超	750	750	11 24	2
物価連動債	500	500	28	1
変動利付債	-	300	-	-

3月10日の予定 (時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
8:50	毎月勤労統計(1月)			-	
	-			-	
	-			-	

本日の市況

無担保コールON物は0.477%の出合から始まり、その後も同程度で推移した。ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.001の0.477%となった。

都銀・信託	証券	地銀
- ~ -	0.477 ~ 0.477	0.477 ~ 0.477

翌営業日のマーケット

出合の水準は本日対比横ばい圏を予想する。

3月7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(3/7~3/10)	5,178	5,178	0.250	0.250		
	0	0				

マネタリーベース [億円]

3月6日時点 6,442,300

所要

今積期の所要準備額	3,669,000
3月10日以降の残り所要	
積数	200
平均	0

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