



短期市場の推移

[億円] [%]

	3月12日	3月13日	3月14日	3月17日
加重平均金利	0.479	0.476	0.477	0.477
東京レボ レート(TN)	0.477	0.478	0.492	0.486
無コール残	87,677	84,065	86,181	85,743
ON	37,903	34,831	37,722	37,734
その他	49,774	49,234	48,459	48,009
有コール残	35,770	37,203	35,602	34,845

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	0.478	0.476	0.496
T/N	-	-	0.630	0.489
S/N	-	-	-	-
1W	0.478	0.530	0.498	0.453
2W	-	-	-	0.435
3W	-	-	-	0.436
1M	-	-	0.555	0.435
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	0.458
6M	-	-	-	0.502
1Y	-	-	-	0.603

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18日	3月19日	3月19日	3月21日	3月21日	3月21日
券		+400	▲300			+0
財政		▲900	+3,000			+70,000
過不足		▲500	+2,700			+70,000
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
国債買入		+10,300				
共通担保(全店)			▲8,000	+8,000		
CP等買入			▲100			
社債等買入			▲200			
国債補充供給	+4,100	▲4,000	+4,000			
当座預金増減		+9,900	+6,400			+70,000
当座預金残高		5,147,400	5,153,800			5,223,800
準備預金残高		4,669,600				
積み終了先		4,625,300				
超過準備		4,572,900				
非準備先残高		477,800				
準備預金進捗率		98.3%				
平均		9.7%				
乖離率		88.6%				

国庫短期証券入札予定

3月21日	3ヶ月(第1295回)
3月28日	3ヶ月
4月4日	3ヶ月
4月9日	6ヶ月

3月27日	40年
3月31日	2年
4月3日	10年
4月8日	30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	オペファー予定日	直近日	残り回数
1年以下	1500	1,500	5		3月5日 0
1年超3年以下	3000	3,000	5 11 17 24		3月17日 1
3年超5年以下	3000	3,000	5 17 24 28		3月17日 2
5年超10年以下	3250	3,250	11 17 24 28		3月17日 2
10年超25年以下	1500	1,500	5 17 28		3月17日 1
25年超	750	750	11 24		3月11日 1
物価連動債	500	500	28		2月26日 1
変動利付債	-	300	-		4月14日 -

3月19日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
日銀金融政策決定会合 (2日目)		(米) FOMC (2日目)	
1月の鉱工業生産確報		(欧) 2月の消費者物価(確 報)	
-		-	

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0.476%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18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
------	------	----	----	----	----	----

米ドル資金供給(3/21~3/27)

0 0 4.580 4.580

国債補充供給(3/18~3/19)

4,309 4,309 0.250 0.250

70 70 0.250 0.250

共通担保(全店)(3/19~4/2)

8,000 18,777 8,012 42.7

マネタリーベース [億円]

3月17日時点 6,371,800

所要

今積期の所要準備額 4,121,700

3月19日以降の残り所要

積数 69,700

平均 2,500

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