



短期市場の推移

	3月21日	3月24日	3月25日	3月26日
加重平均金利	0.477	0.476	0.476	0.477
東京レポレート(TN)	0.495	0.490	0.489	0.486
無コール残	87,129	84,555	82,212	83,275
ON	41,990	39,846	37,403	38,266
その他	45,139	44,709	44,809	45,009
有コール残	36,392	36,007	35,284	34,842

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)

時刻	日本	予想	海外	予想
8:30	3月中旬の東京都都区消費者物価		(米) 2月の個人消費支出	
8:50	金融政策決定会合における主な意見 (3月18日~19日)		-	
	-		-	

	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	0.450	0.478	0.476	0.479	
T/N	-	-	-	0.447	
S/N	-	-	-	-	
1W	0.565	0.690	0.607	0.443	
2W	-	-	-	0.445	
3W	-	-	-	0.445	
1M	-	-	-	0.444	
2M	-	-	-	-	
3M	-	-	0.740	0.461	
6M	-	-	-	0.502	
1Y	-	-	-	0.604	

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。

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

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	3月27日	3月28日	3月28日	3月29日	3月31日	3月31日
券		▲600		+400		+800
財政		+12,300		+18,900		+22,200
過不足		+11,700		+19,300		+23,000
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				▲300		
国債補充供給	+3,100	▲3,600	+3,600			
当座預金増減		+11,200		+22,600		+23,000
当座預金残高		5,276,900		5,299,500		5,322,500
準備預金残高		4,785,700	主な需給要因			
積み終了先		4,784,400	国債発行(40年)	国庫短期証券発行償還(3M)		
超過準備		4,784,300	各種財政資金の支払	各種財政資金の支払		
非準備先残高		491,200	い	い		
準備預金進捗率		99.8%				
平均		38.7%				
乖離率		61.1%				

3月27日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
国債補充供給(3/27~3/28)	3,668	3,668	0.250	0.250		
	0	0				

マネタリーベース [億円]
3月26日時点 6,500,300

所要	[億円]
今積期の所要準備額	4,121,700
3月28日以降の残り所要	
積数	8,200
平均	400

国庫短期証券入札予定

3月28日	3ヶ月(第1296回)
4月4日	3ヶ月
4月9日	6ヶ月
4月11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	5	3月5日	0
1年超3年以下	3000	3,000	5 11 17 24	3月24日	0
3年超5年以下	3000	3,000	5 17 24 28	3月24日	1
5年超10年以下	3250	3,250	11 17 24 28	3月24日	1
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24日	0
物価連動債	500	500	28	2月26日	1
変動利付債	-	300	-	4月14日	-

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