



短期市場の推移

	2月25日	2月26日	2月27日	3月2日
加重平均金利	0.729	0.728	0.727	0.727
東京レボレート(TN)	0.750	0.747	0.750	0.750
無コール残	103,528	102,452	99,583	99,455
ON	42,830	42,504	41,115	41,237
その他	60,698	59,948	58,468	58,218
有コール残	25,624	25,401	24,298	25,292

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、無担保コールは無担保コール残高の重み、
 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	0.700	0.775	0.727	0.748	
T/N	-	-	-	0.750	
S/N	-	-	-	-	
1W	0.710	0.734	0.723	0.747	
2W	0.715	0.780	0.733	0.747	
3W	-	-	-	0.747	
1M	-	-	-	0.748	
2M	-	-	-	-	
3M	-	-	1.100	0.805	
6M	-	-	-	0.880	
1Y	-	-	-	0.990	

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4日の予定 (時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
8:50	日銀当座預金増減要因 (3月見込み)		(米) ADP雇用統計 (1月)	
			(米) サービス業PMMI (2月)	
			(欧) サービス業PMMI (2月)	

本日の市況

無担保コールON物は0.727%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)は前営業対比横ばいの0.727%となった。

都銀・信託	証券	地銀
- ~ -	0.727 ~ 0.727	0.727 ~ 0.727

翌営業日のマーケット

出合いの水準は本日対比横ばい圏を予想する。

資金供給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	3月3日	3月4日	3月4日	3月5日	3月5日	3月5日
券		+300		▲100		+0
財政		▲22,300		▲69,700		▲3,000
過不足		▲22,000		▲69,800		▲3,000
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
共通担保(全店)			▲8,000	+8,000		
国債補完供給	+3,200	▲3,200	+3,200			
社債等買入			▲100			
当座預金増減		▲22,000		▲66,700		▲3,000
当座預金残高		4,543,500		4,476,800		4,473,800
準備預金残高		4,189,900				
積み終了先		4,189,100				
超過準備		4,189,100				
非準備預金残高		353,600				
準備預金進捗率		99.9%				
平均		57.1%				
乖離率		42.8%				

3月3日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	定切	平均	按分
国債補完供給(3/3~3/4)	3,381	3,381	0.550	0.539		
共通担保(全店)(3/4~3/18)	8,000	16,494	8,003		48.5	
米ドル資金供給用担保国債供給(3/4~3/13)	5,000	2	2	0.720	0.720	
米ドル資金供給(3/5~3/12)	1	1	3.890	3.890		

マネタリーベース [億円]
 3月2日時点 5,780,900

所要	[億円]
今積期の所要準備額	3,731,900
3月4日以降の残り所要	
積数	1,800
平均	200

国庫短期証券入札予定

3月6日	3ヶ月(第1366回)
3月9日	6ヶ月(第1367回)
3月13日	3ヶ月
3月17日	1年
3月5日	30年
3月11日	5年
3月13日	10年クワイゼット・トランジション
3月17日	20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	1000	1,000	4		2月4日 1
1年超3年以下	2700	2,700	4	10 16	2月18日 3
3年超5年以下	2450	2,450	4	16 25	2月26日 3
5年超10年以下	2600	2,600	10	16 25	2月26日 3
10年超25年以下	950	950	4	10 25	2月26日 3
25年超	750	750	10	16	2月18日 2
物価連動債	400	400	25		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