



短期市場の推移

	3月3日	3月4日	3月5日	3月6日
加重平均金利	0.727	0.730	0.728	0.728
東京レボレート(TN)	0.750	0.750	0.750	0.751
無コール残	100,519	102,177	101,168	99,822
ON	41,951	43,549	41,910	41,094
その他	58,568	58,628	59,258	58,728
有コール残	25,148	25,771	26,422	26,678

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	0.700	0.780	0.727	0.750
T/N	-	-	-	0.751
S/N	-	-	-	-
1W	0.775	0.780	0.776	0.748
2W	-	-	-	0.747
3W	-	-	0.800	0.747
1M	-	-	0.950	0.749
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	0.808
6M	-	-	-	0.879
1Y	-	-	-	0.992

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10日の予定 (時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
8:50	実質GDP (2次速報、10~12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▲0.001%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。

[%][億円] ※米ドル資金供給は百万\$

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	3月9日	3月10日	3月10日	3月11日	3月11日	3月11日
券		+500	+900	+0	+0	
財政		▲10,900	+1,200	+8,000	+8,000	
過不足		▲10,400	+2,100	+8,000	+8,000	
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
社債等買入	▲100	▲100				
国債補完供給	+3,600	▲3,600	+3,600			
当座預金増減		▲10,500	+5,600	+8,000	+8,000	
当座預金残高		4,480,500	4,486,100	4,494,100	4,494,100	
準備預金残高		4,136,400				主な需給要因
積み終了先		4,136,300	国庫短期証券発行償還			
超過準備		4,136,300	(6M)			
非準備先残高		344,100	国債償還 (物連10年)			
準備預金進捗率		100.0%	流動性供給			
平均		78.6%				
乖離率		21.4%				

3月9日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
国債補完供給(3/9~3/10)	3,926	3,926	0.550	0.550		
	0	0				

マナタリベース [億円]
3月6日時点 5,705,700

所要	[億円]
今積期の所要準備額	3,724,500
3月10日以降の残り所要	
積数	0
平均	0

国庫短期証券入札予定

3月13日	3ヶ月(第1368回)
3月17日	1年
3月18日	3ヶ月
3月27日	3ヶ月
国債入札予定	
3月11日	5年
3月13日	10年クライメート・トランジション
3月17日	20年
3月24日	40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	3月4日	0
1年超3年以下	2700	2,700	4 10 16	3月4日	2
3年超5年以下	2450	2,450	4 16 25	3月4日	2
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	3月4日	2
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