



短期市場の推移

	3月4日	3月5日	3月6日	3月9日
加重平均金利	0.730	0.728	0.728	0.727
東京レボレート(TN)	0.750	0.750	0.751	0.751
無コール残	102,177	101,168	99,822	99,278
ON	43,549	41,910	41,094	39,650
その他	58,628	59,258	58,728	59,628
有コール残	25,771	26,422	26,678	26,156

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	0.728	0.751
T/N	-	-	-	0.752
S/N	-	-	-	-
1W	0.731	0.800	0.743	0.748
2W	-	-	-	0.748
3W	-	-	-	0.748
1M	-	-	-	0.749
2M	-	-	-	-
3M	-	-	1.100	0.811
6M	-	-	-	0.879
1Y	-	-	-	0.991

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11日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	(米) CPI (2月)	-
-	-	(欧) ECB副総裁の講演	-
-	-	-	-

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0.728%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10日	3月11日	3月11日	3月12日	3月12日
券		+900	+400	+0	+0
財政		+6,100	▲400	▲26,000	▲26,000
過不足		+7,000	+0	▲26,000	▲26,000
金融調節	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド
国債買入				+6,600	
国債補充供給	+3,600	▲6,400	+6,400		
社債等買入	▲100				
当座預金増減		+4,100	+13,000	▲26,000	▲26,000
当座預金残高		4,484,600	4,497,600	4,471,600	4,471,600
準備預金残高		4,126,000	主な需給要因		
積み終了先		4,126,000	国債発行(5年)		
超過準備		4,126,000	源泉税揚げ		
非準備先残高		358,600			
準備預金進捗率		100.0%			
平均		82.1%			
乖離率		17.9%			

3月10日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
国債買入(3/11~)						
1~3年	2,700	12,007	2,700	0.013	0.013	90.0
5~10年	2,600	7,853	2,606	▲0.020	▲0.019	52.4
10~25年	950	3,459	956	▲0.035	▲0.033	14.6
25年~	750	1,569	752	▲0.044	▲0.039	85.5
国債補充供給(3/10~3/11)						
	6,925	6,925	0.550	0.550		
	34	34	0.550	0.550		
米ドル資金供給(3/12~3/19)						
	2	2	3.890	3.890		

マナタリベース [億円]
3月9日時点 5,694,700

所要	[億円]
今積期の所要準備額	3,724,500
3月11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(第1369回)
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10日	1
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	3月10日	2
10年超25年以下	950	950	4 10 25	3月10日	1
25年超	750	750	10 16	3月10日	1
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