



短期市場の推移

	2月27日	2月28日	3月3日	3月4日
加重平均金利	0.477	0.477	0.477	0.476
東京レボレート(TN)	0.439	0.465	0.477	0.486
無コール残	86,301	91,984	93,659	85,194
ON	37,097	42,150	43,335	33,890
その他	49,204	49,834	50,324	51,304
有コール残	37,646	37,641	37,424	35,965

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	0.486
T/N	-	-	-	0.480
S/N	-	-	-	-
1W	0.478	0.580	0.491	0.447
2W	-	-	0.545	0.446
3W	-	-	-	0.443
1M	-	-	-	0.437
2M	-	-	-	-
3M	-	-	0.630	0.458
6M	-	-	-	0.497
1Y	-	-	-	0.594

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6日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	(米) 1月の貿易収支	-
-	-	(欧) ECB理事会	-
-	-	-	-

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)は前営業日対比横ばいの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。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想
	3月5日	3月6日	3月6日	3月7日	3月7日
券	+200	+400	+400	+0	+0
財政	▲30,000	+1,700	+1,700	▲6,000	▲6,000
過不足	▲29,800	+2,100	+2,100	▲6,000	▲6,000
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				+8,600	
共通担保(全店)	▲8,000	+8,000			
CP等買入			▲300		
社債等買入	▲100		▲100		
国債補充供給	+2,800	▲3,800	+3,800		
当座預金増減	▲30,900	+14,100	+14,100	▲6,000	▲6,000
当座預金残高	5,198,600	5,212,700	5,212,700	5,206,700	5,206,700
準備預金残高	4,740,400				
積み終了先	4,740,300				
超過準備	4,740,300				
非準備先残高	458,200				
準備預金進捗率	99.9%				
平均	64.3%				
乖離率	35.6%				

3月5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
------	------	----	----	----	----	----

国債買入(3/6~)						
~1年	1,500	4,521	1,501	0.007	0.010	60.1
1~3年	3,000	8,006	3,003	0.010	0.012	8.0
3~5年	3,000	10,877	3,002	0.026	0.028	100.0
10~25年	1,500	3,437	1,502	0.034	0.038	80.2

国債補充供給(3/5~3/6)						
	4,066	4,066	0.250	0.250		
	0	0				

マナタリーベース	【億円】
3月4日時点	6,468,300

所要	【億円】
今積期の所要準備額	3,681,900
3月6日以降の残り所要	
積数	400
平均	0

国庫短期証券入札予定

3月6日	6ヶ月(第1291回)
3月7日	3ヶ月(第1292回)
3月14日	3ヶ月
3月18日	1年
国債入札予定	
3月6日	30年
3月10日	5年
3月12日	20年
3月27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	1500	1,500	5		3月5日
1年超3年以下	3000	3,000	5	11 17 24	3月5日
3年超5年以下	3000	3,000	5	17 24 28	3月5日
5年超10年以下	3250	3,250	11	17 24 28	2月26日
10年超25年以下	1500	1,500	5	17 28	3月5日
25年超	750	750	11	24	2月19日
物価連動債	500	500	28		2月26日
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