

短期市場の推移

[億円] [%]

	2月25日	2月26日	2月27日	2月28日
加重平均金利	▲0.012	▲0.014	▲0.014	▲0.025
東京レポレート(ON)	▲0.085	▲0.081	▲0.081	▲0.075
無コール残	100,310	100,119	98,965	104,106
ON	67,617	69,611	68,152	75,283
その他	32,693	30,508	30,813	28,823
有コール残	19,390	21,764	20,243	21,829

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。

3月3日の予定 (時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
8:50	マネタリーベース(2月)	-	0:00 (米)2月ISM製造業景況指数	51.0
10:00	営業毎旬報告(2月29日現在)	-	-	-
	-	-	-	-

経済指標及び予想値は株式会社フィスコ提供

本日の短期市場金利

[%]

	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	▲0.080	0.001	▲0.023	▲0.073
T/N	-	-	▲0.005	▲0.068
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.030	0.002	▲0.009	▲0.072
2W	-	-	▲0.010	▲0.074
3W	-	-	0.000	▲0.079
1M	-	-	-	▲0.095
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.103
6M	-	-	-	▲0.134
1Y	-	-	-	▲0.160

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

本日の市況

本日の無担保コールON物は▲0.020%の出合から始まった。その後は主に▲0.025%~▲0.010%の水準で取引された。同加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.002%の▲0.023%となった。また、国債買現先オベ(2016年3月18日以来、約4年ぶり)が5,000億円オファーされ、応札倍率は1.14倍となった。なお、応札レート(期間利回り)は▲0.10%を下限とした。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.025 ~ ▲0.025	▲0.020 ~ ▲0.015	▲0.025 ~ ▲0.010

翌営業日のマーケット

ビッドサイドの取引スタンスに変化はなく、出合水準は横ばいを予想する。

資金需給

[億円]

	日銀速報	日銀予想	当社需給予想
	3月2日	3月3日	3月4日
券	+200	▲400	+0
財政	▲42,700	▲18,600	▲78,000
過不足	▲42,500	▲19,000	▲78,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国債買現先		▲5,600	
共通担保(全店)			
CP等買入	▲200	▲600	
社債等買入			
ETF買入		▲700	
国債補完供給	+200	+500	
成長基盤強化支援			▲6,300 +2,200
当座預金増減	▲39,700	▲12,800	▲82,100
当座預金残高	3,978,700	3,965,900	3,883,800
準備預金残高	3,465,100		
積み終了先	3,464,700		
超過準備	3,464,200		
非準備先残高	513,600		
準備預金進捗率	99.9%		
平均	55.2%		
乖離率	44.7%		

3月2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
国債買現先(3/3~3/16)	5,000	5,710	5,000	▲0.100	▲0.092	64.5
国債補完供給(3/2~3/3)		486	486	▲0.350	▲0.350	
		0	0			

マネタリーベース [億円]
2月28日時点 5,158,900

所要 [億円]
今積期の所要準備額 3,026,800
3月3日以降の残り所要
積数 3,100
平均 200

国庫短期証券入札予定

3月6日	3ヶ月	第892回
3月9日	6ヶ月	第893回
3月13日	3ヶ月	
3月17日	1年	
国債入札予定		
3月3日	10年	
3月5日	30年	
3月10日	5年	
3月12日	20年	

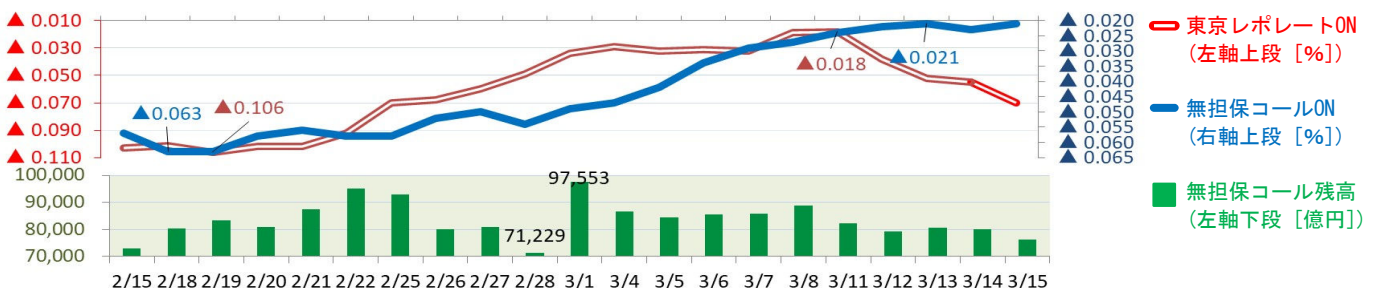
今月の国債買入オペ予定

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	100~1,000 程度	500	月2回程度	2月25日	2
1年超3年以下	3,000~5,500 程度	4,200		2月27日	4
3年超5年以下	2,000~4,500 程度	3,400	4 9 18 27	2月27日	4
5年超10年以下	2,000~5,000 程度	3,500	6 11 18 27	2月27日	4
10年超25年以下	500~2,000 程度	1,200	9 23	2月25日	2
25年超	0~500 程度	300		2月25日	2
物価連動債	300 程度	300	月2回程度	2月25日	2
変動利付債<偶数月>	1,000 程度	1,000	-	2月13日	-

1年前の市場推移

○2019年2月積み期 [2月15日~3月15日]

※積み初日及び積み最終日が祝日・休日の場合は、前営業日のレート・残高を記載しています。



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(登号)第243号 加入協会 日本証券業協会