

短期市場の推移

	2月27日	2月28日	3月2日	3月3日
加重平均金利	▲0.014	▲0.025	▲0.023	▲0.024
東京レポレート(ON)	▲0.081	▲0.075	▲0.073	▲0.083
無コール残	98,965	104,106	119,463	117,109
ON	68,152	75,283	86,845	73,761
その他	30,813	28,823	32,618	43,348
有コール残	20,243	21,829	18,739	18,356

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5日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
鈴木審議委員 金融経済懇談会 出席・会見		22:30	(米)新規失業保険 申請件数[前週分]
-	-	-	(米)10~12月 非農業部門労働生産性 (確報)
-	-	-	(米)1月製造業受注

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	▲0.070	0.001	▲0.032	▲0.107
T/N	▲0.020	▲0.005	▲0.014	▲0.152
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	0.003	▲0.140
2W	▲0.010	0.000	▲0.008	▲0.146
3W	-	-	0.000	▲0.145
1M	-	-	-	▲0.160
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.162
6M	-	-	-	▲0.167
1Y	-	-	-	▲0.178

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▲0.03%の出合から始まり、その後は主に▲0.055~▲0.010%の水準で出合が見られた。昨日と比べ、大手行が調達水準を低下させたことで、同加重平均金利(速報)は、前営業日対比▲0.008%の▲0.032%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.055 ~ ▲0.040	▲0.040 ~ ▲0.040	▲0.050 ~ ▲0.010

翌営業日のマーケット

調達サイドの動向に大きな変化はなく、出合の水準は本日と横ばいを予想。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	3月4日	3月5日	3月5日	3月6日	3月6日	3月6日
券		+100	▲500		+0	
財政		▲71,000	+2,200	▲5,000		
過不足		▲70,900	+1,700	▲5,000		
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
国庫短期証券買入		+5,000				
国債買入				+8,300		
国債買現先		+1,600				
CP等買入	▲100		▲100			
社債等買入			▲100			
ETF買入		+100				
国債補完供給	+1,000	▲400	+400			
成長基盤強化支援	▲3,500	+2,200			▲100	
当座預金増減		▲65,000	+10,200	▲5,100		
当座預金残高		3,899,300	3,909,500	3,904,400		
準備預金残高		3,390,100	主な需給要因			
積み終了先		3,389,800				
超過準備		3,389,700				
非準備先残高		509,200				
準備預金進捗率		99.9%				
平均		62.1%				
乖離率		37.8%				

3月4日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	接分
国債買入(3/5~)						
~1年	500	1,397	502	▲0.013	▲0.003	71.4
1~3年	4,200	13,206	4,201	▲0.045	▲0.043	74.8
3~5年	3,400	11,381	3,405	▲0.067	▲0.063	54.8
CP等買入(3/9~)						
	4,000	11,090	3,994	▲0.001	0.002	50.2
国債補完供給(3/4~3/5)						
	341	341	▲0.350	▲0.350		

マナタリーベース [億円]	所要 [億円]
3月3日時点 5,104,900	今積期の所要準備額 3,026,800
	3月5日以降の残り所要積数 2,300
	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5日	30年	
3月10日	5年	
3月12日	20年	
3月26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	100~1,000 程度	500	月2回程度	3月4日	1
1年超3年以下	3,000~5,500 程度	4,200			
3年超5年以下	2,000~4,500 程度	3,400	4 9 18 27	3月4日	3
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			
25年超	0~500 程度	300	9 23	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。