

短期市場の推移

[億円] [%]

	3月18日	3月19日	3月23日	3月24日
加重平均金利	▲0.063	▲0.051	▲0.048	▲0.039
東京レポレート(ON)	▲0.199	▲0.223	▲0.536	▲0.833
無コール残	106,619	117,668	121,986	116,487
ON	73,811	76,770	81,458	80,484
その他	32,808	40,898	40,528	36,003
有コール残	10,602	10,633	8,156	7,863

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26日の予定(時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	21:30	(米)新規失業保険申請件数[前週分]
-	-	22:30	(米)10-12月期国内総生産(GDP)確報値[前期比年率]
-	-	-	2.1%

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	▲0.087	0.001	▲0.028	▲0.229
T/N	▲0.015	0.000	▲0.005	▲0.284
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	-	▲0.401
2W	-	-	-	▲0.319
3W	-	-	-	▲0.311
1M	-	-	-	▲0.284
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.277
6M	-	-	-	▲0.272
1Y	-	-	-	▲0.270

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▲0.025%の出合から始まり、その後は主に▲0.060~▲0.010%の水準で出合が見られた。同加重平均金利(速報)は、前営業日対比+0.011%の▲0.028%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.060 ~ ▲0.050	▲0.040 ~ ▲0.030	▲0.040 ~ ▲0.010

翌営業日のマーケット

引き続き調達意欲は底堅く、出合の水準は小幅上昇を予想。

資金需給

[億円]

	日銀速報	日銀予想	当社需給予想
	3月25日	3月26日	3月27日
券	▲500	▲1,400	▲1,000
財政	+15,900	+14,900	▲3,000
過不足	+15,400	+13,500	▲4,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国債売現先	▲8,000	▲4,000	-
CP等買入	▲700	▲600	-
ETF買入	-	+600	-
国債補完供給	+22,400	+5,900	-
米ドル供給用担保国債供給	▲98,200	▲2,700	+2,400
新型コロナ企業金融支援特別貸出	▲100	-	-
社債等買入	-	-	+2,000
当座預金増減	▲39,900	+12,700	+400
当座預金残高	3,943,700	3,956,400	3,956,800
準備預金残高	3,431,800	-	-
積み終了先	3,430,600	-	-
超過準備	3,430,300	-	-
非準備先残高	511,900	-	-
準備預金進捗率	99.6%	-	-
平均	32.3%	-	-
乖離率	67.3%	-	-

3月25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
国債売現先(3/26~4/3)	4,000	24,300	4,000	▲0.550	▲0.550	-
国債売現先(3/31~4/1)	20,000	27,400	20,000	▲0.150	▲0.429	30.0
米ドル資金供給(3/27~4/3)	4,950	4,950	0.340	0.340	-	-
国債補完供給(3/25~3/26)	5,516	5,182	▲0.550	▲0.644	-	-
	255	255	▲0.550	▲0.550	-	-
米ドル資金供給用担保国債供給(3/26~4/6)	5,000	2,678	2,678	▲0.100	▲0.100	-

マネタリーベース [億円]
3月24日時点 5,125,500

所要 [億円]
今積期の所要準備額 3,247,700
3月26日以降の残り所要
積数 13,800
平均 700

国庫短期証券入札予定

3月27日	3ヶ月	第89/回
4月3日	3ヶ月	-
4月9日	6ヶ月	-
4月10日	3ヶ月	-
国債入札予定	-	-
3月26日	40年	-
3月31日	2年	-
4月2日	10年	-
4月7日	30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11日	0
1年超3年以下	3,000~5,500 程度	2,000	4 9 17 18 27	3月19日	1
3年超5年以下	1,000~4,500 程度	3,000	6 11 17 18 27	3月23日	1
5年超10年以下	1,000~5,000 程度	5,000	9 23	3月23日	0
10年超25年以下	500~2,000 程度	1,200	-	3月18日	0
25年超	0~500 程度	300	-	2月13日	-
物価連動債	300 程度	500	月2回程度	-	-
変動利付債<偶数月>	1,000 程度	1,000	-	-	-

1年前の市場推移

○2019年3月積み期 [3月15日~4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。