

短期市場の推移

	3月23日	3月24日	3月25日	3月26日
加重平均金利	▲0.048	▲0.039	▲0.028	▲0.020
東京レポレート(ON)	▲0.536	▲0.833	▲0.229	▲0.191
無コール残	121,986	116,487	118,396	121,727
ON	81,458	80,484	83,393	85,824
その他	40,528	36,003	35,003	35,903
有コール残	8,156	7,863	8,752	7,457

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30日の予定(時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
8:50	製造業部門別投入・ 産出物価指数(2月)	(米)中古住宅販売仮契 約(2月)	
	-	(米)ダラス連銀製造業 活動指数(3月)	
	-	-	

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	▲0.017	▲0.126
T/N	▲0.005	0.000	▲0.005	▲0.160
S/N	-	-	▲0.001	-
1W	-	-	-	▲0.189
2W	-	-	0.180	▲0.185
3W	-	-	0.200	▲0.185
1M	-	-	-	▲0.188
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.202
6M	-	-	-	▲0.251
1Y	-	-	-	▲0.259

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▲0.010%の出合から始まり、
 その後は主に▲0.030~▲0.001%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+0.003%の▲0.017%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.030 ~ ▲0.030	▲0.010 ~ ▲0.005	▲0.030 ~ ▲0.001

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、本日と同様の地合になると予想。

資金需給

	日銀速報 3月27日	日銀予想 3月30日	当社需給予想 3月31日
券	▲900	▲500	+0
財政	▲4,300	+40,100	+8,400
過不足	▲5,200	+39,600	+8,400
金融調節	エンド	スタート	エンド
国債買入			+11,500
国債売現先	▲8,000	▲8,000	+16,000
共通担保(全店)		▲8,800	▲20,000
CP等買入	▲600	▲700	+5,500
社債等買入	+2,000		
ETF買入	+1,000		
国債補充供給	+3,400	+1,600	+300
米ドル供給用担保国債供給	+2,500	▲1,400	▲15,800
当座預金増減	▲7,900	+30,500	+9,900
当座預金残高	3,945,700	3,976,200	3,986,100
準備預金残高	3,418,000		
積み終了先	3,417,300		
超過準備	3,416,000		
非準備預金残高	527,700		
準備預金進捗率	99.8%		
平均	45.2%		
乖離率	54.6%		

3月27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	接分
国債売現先(3/30~4/2)	8,000	26,500	8,000	▲0.210	▲0.240	
国債買入(3/30~)						
1~3年	4,200	10,706	4,205	0.025	0.027	46.3
3~5年	3,400	7,856	3,403	▲0.004	0.006	81.8
5~10年	3,500	9,335	3,502	0.000	0.004	16.9
米ドル資金供給(3/31~4/7)						
	13,100	13,100	0.340	0.340		
国債補充供給(3/27~3/30)						
	1,478	1,478	▲0.350	▲0.350		
	69	69	▲0.350	▲0.350		
共通担保(全店)(3/30~4/13)						
	20,000	10,770				
米ドル資金供給用担保国債供給(3/30~4/8)						
	20,000	15,437	15,437	▲0.100	▲0.100	

マナタリーベース [億円]	所要 [億円]
3月26日時点 5,097,600	今積期の所要準備額 3,247,700
	3月30日以降の残り所要積数 6,400
	平均 400

国庫短期証券入札予定

4月3日	3ヶ月	第898回
4月9日	6ヶ月	
4月10日	3ヶ月	
4月16日	1年	
3月31日	2年	
4月2日	10年	
4月7日	30年	
4月9日	5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	4,200			
3年超5年以下	1,000~4,500 程度	3,400	4 9 17 18 27	3月27日	0
5年超10年以下	1,000~5,000 程度	3,500	6 11 17 18 27	3月27日	0
10年超25年以下	500~2,000 程度	1,200			
25年超	0~500 程度	300	9 23	3月23日	0
物価連動債	300 程度	500	月2回程度	3月18日	0
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。