

短期市場の推移

[億円] [%]

	2月22日	2月25日	2月26日	2月27日
加重平均金利	▲0.058	▲0.058	▲0.052	▲0.050
東京レポレート(ON)	▲0.092	▲0.070	▲0.068	▲0.060
無コール残	95,105	92,838	80,063	80,897
ON	59,120	56,743	53,823	54,327
その他	35,985	36,095	26,240	26,570
有コール残	30,749	24,765	22,888	23,118

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1日の予定 (時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
8:30	1月有効求人倍率	1.63倍	19:00	(欧)1月失業率 7.9%
13:00	日銀当座預金増減要因と金融調節(2月実績)	-	19:00	(欧)2月消費者物価コア指数[前年比] 1.1%
-	【記者会見】鈴木審議委員(2月28日)	-	-	(米)ISM製造業景況指数 56.2

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	▲0.086	0.001	▲0.055	▲0.049
T/N	-	-	▲0.020	▲0.049
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.030	▲0.012	▲0.021	▲0.056
2W	▲0.025	▲0.010	▲0.018	▲0.063
3W	-	-	-	▲0.085
1M	-	-	▲0.035	▲0.113
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.142
6M	-	-	-	▲0.157
1Y	-	-	-	▲0.157

無担保コール(速報)は日銀、東京レポレートは日本証券協会公表

本日の市況

本日の無担保コールON物は▲0.080%の出合から始まった。その後は主に▲0.086~▲0.020%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▲0.005%の▲0.055%となった。

業態別出合レンジ

都銀・信託	証券	地銀
▲0.086 ~ ▲0.080	▲0.085 ~ ▲0.080	▲0.080 ~ ▲0.020

翌営業日のマーケット

週末3日積みとなるため調達意欲が強まり、出合の水準は小幅上昇と予想する。

資金需給

[億円]

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	2月28日	3月1日	3月1日	3月4日	3月4日	3月4日
券	▲1,200	▲400	▲400	+1,000	+1,000	+1,000
財政	+4,700	▲37,200	▲37,200	▲61,000	▲61,000	▲61,000
過不足	+3,500	▲37,600	▲37,600	▲60,000	▲60,000	▲60,000
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
国債買入		+12,000				
共通担保(全店)				▲700	▲700	
CP等買入	▲1,800	+2,000	▲300			
ETF買入		+700				
国債補完供給	+100	▲300	+300			
成長基盤強化支援				▲6,500	+2,900	
当座預金増減	+16,200	▲37,600	▲37,600	▲64,300	▲64,300	▲64,300
当座預金残高	3,854,700	3,817,100	3,817,100	3,752,800	3,752,800	3,752,800
準備預金残高	3,366,700					
積み終了先	3,366,400					
超過準備	3,366,400					
非準備預金残高	488,000					
準備預金進捗率	99.9%					
平均	46.4%					
乖離率	53.5%					
			国債発行(2年)	税・保険揚げ		
				国庫短期償還		
				(3M)発行償還		

2月28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
国債補完供給(2/28~3/1)	77,159	328	328	▲0.600	▲0.600	

マナタリーベース [億円]
2月27日時点 4,956,900

所要	[億円]
今積期の所要準備額	2,818,000
3月1日以降の残り所要積数	3,000
平均	200

国庫短期証券入札予定

3月1日	3ヶ月	第817回
3月7日	6ヶ月	第818回
3月8日	3ヶ月	
3月14日	3ヶ月	
3月5日	10年	
3月7日	30年	
3月12日	5年	
3月19日	20年	

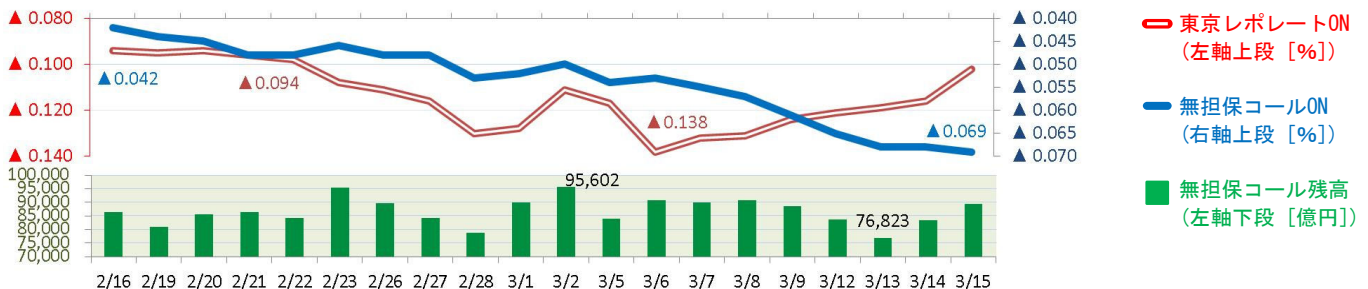
来月の国債買入オペ予定

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14日	2
1年超3年以下	2,500~4,500 程度	3,500			
3年超5年以下	3,000~5,500 程度	4,000	4 8 18 25	2月27日	4
5年超10年以下	3,000~6,500 程度	4,300	6 13 20 29	2月27日	4
10年超25年以下	1,500~2,500 程度	1,800			
25年超	100~1,000 程度	500	4 13 25 29	2月22日	4
物価運動債	250 程度	250	月2回程度	2月22日	2
変動利付債<偶数月>	1,000 程度	1,000	1回	2月14日	0

1年前の市場推移

○2018年2月積み期 [2月16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。