

短期市場の推移

[億円] [%]

3月4日の予定 (時刻は日本時間)

	2月25日	2月26日	2月27日	2月28日
加重平均金利	▲0.058	▲0.052	▲0.050	▲0.054
東京レポレート(ON)	▲0.070	▲0.068	▲0.060	▲0.049
無コール残	92,838	80,063	80,897	71,229
ON	56,743	53,823	54,327	48,119
その他	36,095	26,240	26,570	23,110
有コール残	24,765	22,888	23,118	23,905

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。

日本		予想	海外		予想
8:50	マネタリーベース(2月)	-	19:00	(欧)1月生産者物価指数 [前年比]	-
10:00	営業毎旬報告 (2月28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 東京レポレート
	最低	最高	平均	
O/N	▲0.086	0.001	▲0.049	▲0.034
T/N	-	-	▲0.020	▲0.029
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.040	▲0.020	▲0.032	▲0.038
2W	▲0.045	▲0.025	▲0.037	▲0.053
3W	-	-	-	▲0.079
1M	-	-	0.050	▲0.113
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.140
6M	-	-	-	▲0.154
1Y	-	-	-	▲0.156

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▲0.060%の出合から始まった。
その後は主に▲0.080~▲0.020%の水準で出合が見られた。
共通担保オペ(全店貸付・固定金利方式)のオファー額が15,000億円と、2016年7月以來約2年8か月ぶりの大きさとなった。

業態別出合レンジ

[%]

都銀・信託	証券	地銀
▲0.080 ~ ▲0.070	▲0.075 ~ ▲0.020	▲0.075 ~ ▲0.020

翌営業日のマーケット

引き続き資金調達ニーズは強く、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 3月1日	日銀予想 3月4日	当社需給予想 3月5日
券	▲500	+700	+1,000
財政	▲39,700	▲54,100	+2,000
過不足	▲40,200	▲53,400	+3,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
共通担保(全店)		▲700	+2,600
CP等買入	▲300	▲200	
国債補完供給	+300	+200	
成長基盤強化支援		▲5,100	+2,900
当座預金増減	▲40,400	▲53,700	+3,000
当座預金残高	3,814,300	3,760,600	3,763,600
準備預金残高	3,354,400	主な需給要因	
積み終了先	3,354,100		
超過準備	3,354,100		
非準備預金残高	459,900		
準備預金進捗率	99.9%		
平均	57.1%		
乖離率	42.8%		

3月1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
国債補完供給(3/1~3/4)	38,130	183	183	▲0.600	▲0.600	
共通担保(全店)(3/4~3/18)	15,000	2,630	2,630			

マネタリーベース [億円]
2月28日時点 4,974,200

所要	[億円]
今積期の所要準備額	2,818,000
3月4日以降の残り所要	
積数	2,000
平均	200

国庫短期証券入札予定

3月7日	6ヶ月	第818回
3月8日	3ヶ月	第819回
3月14日	3ヶ月	
3月19日	1年	
国債入札予定		
3月5日	10年	
3月7日	30年	
3月12日	5年	
3月19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	4 13 25 29	2月22日	4
25年超	100~1,000 程度	500			
物価連動債	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。