

短期市場の推移

[億円][%]

3月6日の予定(時刻は日本時間)

	2月27日	2月28日	3月1日	3月4日
加重平均金利	▲0.050	▲0.054	▲0.049	▲0.047
東京レポレート(ON)	▲0.060	▲0.049	▲0.034	▲0.029
無コール残	80,897	71,229	97,553	86,549
ON	54,327	48,119	72,083	61,649
その他	26,570	23,110	25,470	24,900
有コール残	23,118	23,905	21,836	21,411

日本		予想	海外		予想
10:30	【挨拶】原田審議委員(山梨)	-	22:15	(米)2月ADP全米雇用報告	18.0万人
	-			(米)ページブック	
	-			(米)NY連銀総裁講演	

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。無コール残は無担保・有担保コール残高の意。

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	▲0.042	▲0.032
T/N	-	-	▲0.020	▲0.035
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.030	▲0.010	▲0.020	▲0.041
2W	-	-	▲0.035	▲0.057
3W	-	-	▲0.005	▲0.083
1M	-	-	-	▲0.110
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.131
6M	-	-	-	▲0.154
1Y	-	-	-	▲0.156

本日の市況

本日の無担保コールON物は▲0.055%の出合から始まった。その後は主に▲0.070~▲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▲0.042%となった。

業態別出合レンジ

都銀・信託	証券	地銀
▲0.070 ~ ▲0.060	▲0.060 ~ ▲0.035	▲0.070 ~ ▲0.010

翌営業日のマーケット

資金調達ニーズは強く、引き続き堅調な地合となる見込み。

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

資金需給

[億円]

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	3月5日	3月6日	3月6日	3月7日	3月7日	3月7日
券	▲100	+300		+0		+0
財政	▲7,900	▲21,500		+2,000		+2,000
過不足	▲8,000	▲21,200		+2,000		+2,000
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				+2,500		
国債買入	+10,100					
CP等買入	▲300	▲200				
国債補完供給	▲500	+500				
当座預金増減	+1,300	▲18,400		+2,000		
当座預金残高	3,763,000	3,744,600		3,746,600		
準備預金残高	3,314,100					
積み終了先	3,313,900					
超過準備	3,313,900					
非準備先残高	448,900					
準備預金進捗率	99.9%					
平均	64.3%					
乖離率	35.6%					

3月5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
国庫短期証券買入(3/6~)	2,500	12,981	2,500	0.031	0.032	98.9
米ドル資金供給(3/7~3/14)			2	2.910	2.910	
CP等買入(3/8~)	3,500	7,665	3,492	▲0.006	0.000	30.6
国債補完供給(3/5~3/6)	11,921	0	0			
	10,000	489	489	▲0.500	▲0.500	
米ドル資金供給用担保国債供給(3/6~3/15)	5,000	2	2	▲0.100	▲0.100	

マナタリーベース [億円]
3月4日時点 4,881,200

所要 [億円]
今積期の所要準備額 2,818,000
3月6日以降の残り所要積数 1,500
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7日	30年	
3月12日	5年	
3月19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	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	3月4日 3
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	3月4日 3
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	1

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。