

平成31年3月6日(水)

短期市場の推移

[億円] [%]

3月7日の予定 (時刻は日本時間)

	2月28日	3月1日	3月4日	3月5日
加重平均金利	▲0.054	▲0.049	▲0.047	▲0.042
東京レポレート(ON)	▲0.049	▲0.034	▲0.029	▲0.032
無コール残	71,229	97,553	86,549	84,580
ON	48,119	72,083	61,649	59,230
その他	23,110	25,470	24,900	25,350
有コール残	23,905	21,836	21,411	21,536

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。

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	▲0.080	0.001	▲0.034	▲0.031
T/N	▲0.035	▲0.020	▲0.029	▲0.035
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.015	0.005	▲0.011	▲0.041
2W	-	-	▲0.020	▲0.057
3W	-	-	-	▲0.084
1M	-	-	-	▲0.111
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.131
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▲0.050%の出合から始まった。
その後は主に▲0.055~▲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+0.008%の▲0.034%となった。

業態別出合レンジ

[%]

都銀・信託	証券	地銀
▲0.055 ~ ▲0.050	▲0.050 ~ ▲0.050	▲0.055 ~ ▲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。

資金需給

[億円]

	日銀速報	日銀予想	当社需給予想
	3月6日	3月7日	3月8日
券		+300	▲600
財政		▲21,300	+8,700
過不足		▲21,000	+8,100
金融調節	エンド	スタート	エンド
国庫短期証券買入		+2,500	
国債買入			+5,200
CP等買入	▲200	▲200	+3,500
国債補完供給	+500		
当座預金増減	▲18,200	+13,100	▲1,500
当座預金残高	3,744,800	3,757,900	3,756,400
準備預金残高	3,296,500	主な需給要因	
積み終了先	3,296,300		
超過準備	3,296,300		
非準備先残高	448,300		
準備預金進捗率	99.9%		
平均	67.9%		
乖離率	32.0%		

3月6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

国債買入(3/7~)						
5~10年	4,800	12,443	4,805	▲0.005	▲0.004	90.2
物価連動	250	1,394	253	0.030	▲0.024	50.0
国債補完供給(3/6~3/7)						
	59,266	0	0			

マネタリーベース [億円]
3月5日時点 4,882,700

所要 [億円]
今積期の所要準備額 2,818,000
3月7日以降の残り所要
積数 1,300
平均 100

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	4,800	6 13 20 29	3月6日	3
10年超25年以下	1,500~2,500 程度	1,800	4 13 25 29	3月4日	3
25年超	100~1,000 程度	500			
物価連動債	250 程度	250	月2回程度	3月6日	1
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。