

### 短期市場の推移

[億円][%]

3月13日の予定(時刻は日本時間)

	3月6日	3月7日	3月8日	3月11日
加重平均金利	▲0.034	▲0.029	▲0.027	▲0.024
東京レポレート(ON)	▲0.031	▲0.032	▲0.019	▲0.018
無コール残	85,650	85,899	88,948	82,363
ON	60,970	62,419	61,618	55,203
その他	24,680	23,480	27,330	27,160
有コール残	21,480	21,429	20,985	20,930

	日本	予想	海外	予想
8:50	2月国内企業物価指数[前年比]	+0.7%	20:00	(米)MBA住宅ローン申請指数[前週比]
8:50	1月機械受注[前月比]	▲2.0%	21:30	(米)2月生産者物価コア指数[前年比]

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。

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	▲0.022	▲0.038
T/N	-	-	▲0.020	▲0.047
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	-	▲0.076
2W	▲0.005	0.000	▲0.002	▲0.089
3W	-	-	0.050	▲0.115
1M	-	-	-	▲0.113
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.131
6M	-	-	-	▲0.152
1Y	-	-	-	▲0.154

### 本日の市況

本日の無担保コールON物は▲0.030%の出合から始まり、その後は主に▲0.035~▲0.01%のレンジで取引された。昨日同様、資金調達ニーズは強く、同加重平均金利(速報)は、前営業日対比+0.002%の▲0.022%となった。

都銀・信託		証券	地銀
▲0.030 ~ ▲0.030		▲0.025 ~ ▲0.025	▲0.045 ~ ▲0.010

### 翌営業日のマーケット

引き続き資金調達ニーズは強く、堅調な地合を予想する。

### 資金需給

[億円]

	日銀速報 3月12日	日銀予想 3月13日	当社需給予想 3月14日
券	+500	+400	+0
財政	+5,600	▲21,400	+2,000
過不足	+6,100	▲21,000	+2,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国庫短期証券買入			+5,000
CP等買入	▲300	▲200	
国債補完供給	+1,000	+800	
当座預金増減	+6,000	▲15,400	+2,000
当座預金残高	3,757,600	3,742,200	3,744,200
準備預金残高	3,295,800	主な需給要因	
積み終了先	3,295,700	源泉税揚げ	
超過準備	3,295,700	国債発行(5年)	
非準備預金残高	461,800		
準備預金進捗率	99.9%		
平均	89.3%		
乖離率	10.6%		

### 3月12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(3/13~)	5,000	17,732	5,001	0.012	0.016	13.5
米ドル資金供給(3/14~3/22)			3	2.900	2.900	
CP等買入(3/15~)	3,500	8,505	3,490	▲0.011	▲0.009	80.8
国債補完供給(3/12~3/13)	74,013	332	332	▲0.500	▲0.500	
	33,735	422	422	▲0.500	▲0.500	

マナタリーベース [億円]	所要 [億円]
3月11日時点 4,870,900	今積期の所要準備額 2,813,500
	3月13日以降の残り所要積数 400
	平均 100

### 国庫短期証券入札予定

### 今月の国債買入オペ予定

3月14日	3ヶ月	第820回
3月19日	1年	第821回
3月22日	3ヶ月	
4月3日	3ヶ月	
国債入札予定		
3月19日	20年	
3月26日	40年	
3月28日	2年	
4月2日	10年	

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8日	1
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 6 18 25	3月8日	2
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			
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	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。