

短期市場の推移

[億円] [%]

3月14日の予定 (時刻は日本時間)

	3月7日	3月8日	3月11日	3月12日
加重平均金利	▲0.029	▲0.027	▲0.024	▲0.022
東京レポレート(ON)	▲0.032	▲0.019	▲0.018	▲0.038
無コール残	85,899	88,948	82,363	79,280
ON	62,419	61,618	55,203	58,120
その他	23,480	27,330	27,160	21,160
有コール残	21,429	20,985	20,930	21,617

日本		予想	海外		予想
日銀金融政策決定会合 (15日まで)			21:30	(米)新規失業保険申請件数[前週分]	-
			23:00	(米)1月新築住宅販売件数	-
				(米)輸出入物価(2月)	

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	▲0.021	▲0.052
T/N	-	-	▲0.020	▲0.070
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.010	0.001	▲0.009	▲0.095
2W	▲0.020	▲0.005	▲0.019	▲0.107
3W	-	-	-	▲0.126
1M	-	-	-	▲0.126
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.134
6M	-	-	-	▲0.152
1Y	-	-	-	▲0.154

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▲0.030%の出合から始まり、その後は主に▲0.040~▲0.010%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+0.001%の▲0.021%と9営業日連続で上昇した。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.040 ~ ▲0.025	▲0.020 ~ ▲0.020	▲0.040 ~ ▲0.005

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		日銀予想		当社需給予想	
	3月13日	3月14日	3月14日	3月15日	3月15日	3月16日
券		+400	▲400		+0	
財政		▲21,400	+2,000		+5,000	
過不足		▲21,000	+1,600		+5,000	
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		+5,000				
国債買入				+7,600		
CP等買入	▲200		▲500		+3,500	
社債等買入			▲100			
国債補完供給	+800	▲100	+100			
当座預金増減		▲15,500	+8,700		+8,500	
当座預金残高		3,742,100	3,750,800		3,759,300	
準備預金残高		3,291,900				
積み終了先		3,291,700				
超過準備		3,291,700				
非準備先残高		450,200				
準備預金進捗率		99.9%				
平均		92.9%				
乖離率		7.0%				
主な需給要因						
国債償還(2年)						

3月13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
国債買入(3/14~)						
5~10年	4,800	12,577	4,802	▲0.016	▲0.013	24.7
10~25年	1,800	5,164	1,814	▲0.013	▲0.012	84.3
25年~	500	2,211	509	▲0.015	▲0.014	46.2
国債補完供給(3/13~3/14)						
40,155	52	52	▲0.500	▲0.500		
3,730	5	5	▲0.500	▲0.500		

マナタリーベース [億円]	所要 [億円]
3月12日時点 4,876,500	今積期の所要準備額 2,813,500
	3月14日以降の残り所要積数 200
	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13日	2
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13日	2
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。