

短期市場の推移

[億円] [%]

3月15日の予定 (時刻は日本時間)

	3月8日	3月11日	3月12日	3月13日
加重平均金利	▲0.027	▲0.024	▲0.022	▲0.021
東京レポレート(ON)	▲0.019	▲0.018	▲0.038	▲0.052
無コール残	88,948	82,363	79,280	80,684
ON	61,618	55,203	58,120	59,534
その他	27,330	27,160	21,160	21,150
有コール残	20,985	20,930	21,617	21,422

	日本	予想	海外	予想
-	金融政策決定会合の結果	-	21:30	(米)3月NY連銀製造業景気指数 10.0
17:55	【挨拶】黒田総裁 (B20東京サミット)	-	23:00	(米)3月ミンガン大消費者信頼感速報 95.0

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	▲0.080	0.001	▲0.023	▲0.055
T/N	-	-	▲0.020	▲0.068
S/N	-	-	-	-
1W	0.000	0.230	0.021	▲0.092
2W	-	-	-	▲0.103
3W	-	-	-	▲0.126
1M	-	-	-	▲0.125
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.133
6M	-	-	-	▲0.152
1Y	-	-	-	▲0.155

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。同加重平均金利(速報)は、前営業日対比▲0.001%の▲0.023%となった。

都銀・信託		証券	地銀
▲0.030 ~ ▲0.025		▲0.025 ~ ▲0.025	▲0.040 ~ ▲0.005

翌営業日のマーケット

来積み期にもかかる取引となることから、調達サイドの一部は慎重な動きとなることが予想される。

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 3月14日	日銀予想 3月15日	当社需給予想 3月18日
券	▲300	▲200	+0
財政	+1,600	+11,400	+11,000
過不足	+1,300	+11,200	+11,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国債買入	+7,600		
共通担保(全店)			▲2,600
CP等買入	▲500	▲400	+3,500
社債等買入	▲100		
国債補完供給	+100		▲44,000
貸出増加支援			+37,700
当座預金増減	+8,400	+14,300	+2,100
当座預金残高	3,750,500	3,764,800	3,766,900
準備預金残高	3,302,800	主な需給要因	
積み終了先	3,302,700		
超過準備	3,302,700		
非準備預金残高	447,700		
準備預金進捗率	99.9%	国債償還(2年)	国庫短期証券発行・償還(3M)
平均	96.4%		
乖離率	3.5%		

3月14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
国債補完供給(3/14~3/15)	21,451	0	0			

マナタリーベース [億円]
3月13日時点 4,860,600

所要	[億円]
今積期の所要準備額	2,813,500
3月15日以降の残り所要積数	100
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19日	1年	第821回
3月22日	3ヶ月	
4月3日	3ヶ月	
4月5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。