

短期市場の推移

[億円][%]

3月19日の予定(時刻は日本時間)

	3月12日	3月13日	3月14日	3月15日
加重平均金利	▲0.022	▲0.021	▲0.023	▲0.021
東京レポレート(ON)	▲0.038	▲0.052	▲0.055	▲0.070
無コール残	79,280	80,684	80,112	76,163
ON	58,120	59,534	58,262	56,293
その他	21,160	21,150	21,850	19,870
有コール残	21,617	21,422	21,217	19,637

	日本	予想	海外	予想
8:50	資金循環統計(速報) (10~12月期)	-	20:00	(米)MBA住宅ローン 申請指数(前週比)
	-			(米)FOMC(20日まで)
	-			-

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	▲0.051	▲0.084
T/N	-	-	▲0.020	▲0.102
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.030	0.005	▲0.023	▲0.111
2W	-	-	0.001	▲0.143
3W	-	-	-	▲0.134
1M	-	-	▲0.025	▲0.133
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.134
6M	-	-	-	▲0.152
1Y	-	-	-	▲0.155

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▲0.060%の出合から始まり、その後は主に▲0.080~▲0.020%のレンジで取引された。新積み期に入ったこともあり、ビッドサイドが慎重な動きとなったことから、同加重平均金利(速報)は、前営業日対比▲0.030%の▲0.051%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.085 ~ ▲0.085	▲0.070 ~ ▲0.070	▲0.080 ~ ▲0.020

翌営業日のマーケット

引き続き、ビッドサイドは慎重な調達姿勢となると予想する。

資金需給

[億円]

	日銀速報 3月18日	日銀予想 3月19日	当社需給予想 3月20日
券	+200	▲500	▲1,000
財政	▲3,700	+3,000	+98,000
過不足	▲3,500	+2,500	+97,000
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			+7,900
共通担保(全店)	▲2,600	+1,600	
CP等買入			▲200
ETF買入		+200	+600
国債補完供給	+100	▲1,000	+1,000
貸出増加支援	▲22,400	+37,700	
当座預金増減	+10,100	+14,300	+97,000
当座預金残高	3,775,700	3,790,000	3,887,000
準備預金残高	3,301,300	主な需給要因	
積み終了先	3,269,100	国庫短期証券 発行・償還(1Y) 国債発行(20年) 国債償還 (5, 10, 20, 変動15年)	
超過準備	3,242,700		
非準預先残高	474,400		
準備預金進捗率	97.0%		
平均	9.7%		
乖離率	87.3%		

3月18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(3/19~)	2,500	8,728	2,502	0.000	0.002	96.3
国債買入(3/19~)						
1~3年	3,500	11,434	3,510	▲0.003	▲0.002	47.2
3~5年	4,000	13,054	4,005	▲0.004	▲0.003	14.1
物価連動	250	1,099	251	0.080	0.006	44.4
社債等買入(3/25~)						
750	2,026	750	0.043	0.061	77.1	
国債補完供給(3/18~3/19)	82,367	884	884	▲0.500	▲0.500	

マナタリーベース [億円]
3月15日時点 4,884,500

所要 [億円]
今積期の所要準備額 3,096,400
3月19日以降の残り所要積数 93,400
平均 3.300

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	第822回
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18日	1
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18日	0
変動利付債<偶数月>	1,000 程度	1,000	-	2月14日	-

1年前の市場推移

○2018年3月積み期 [3月16日~4月13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。