

短期市場の推移

[億円][%]

3月26日の予定(時刻は日本時間)

	3月18日	3月19日	3月20日	3月22日
加重平均金利	▲0.051	▲0.053	▲0.059	▲0.061
東京レポレート(ON)	▲0.084	▲0.104	▲0.107	▲0.127
無コール残	88,403	77,778	91,127	96,130
ON	67,563	57,033	68,202	66,125
その他	20,840	20,745	22,925	30,005
有コール残	20,581	18,290	19,192	14,039

日本		予想	海外		予想
8:50	金融政策決定会合における 主な意見(3月14・15日分)	-	21:30	(米)2月住宅着工件数	122.5万戸
-	-	-	22:00	(米)1月のFHFA 住宅価格指数	0.4%
-	-	-	23:00	(米)2月消費者信頼感指数	132.0

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	▲0.086	0.001	▲0.062	▲0.136
T/N	-	-	▲0.020	▲0.150
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	0.040	▲0.221
2W	-	-	-	▲0.170
3W	-	-	-	▲0.148
1M	-	-	-	▲0.144
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.144
6M	-	-	-	▲0.155
1Y	-	-	-	▲0.157

本日の市況

本日の無担保コールON物は▲0.075%の出合から始まり、その後は主に▲0.086~▲0.020%のレンジで取引された。先週末同様軟調な地合となり、同加重平均金利(速報)は、前営業日対比▲0.001%の▲0.062%と5営業日連続で低下した。

都銀・信託		証券	地銀
▲0.086 ~ ▲0.086		▲0.085 ~ ▲0.085	▲0.085 ~ ▲0.020

翌営業日のマーケット

引き続き軟調な地合を予想する。

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	日銀予想	当社需給予想
	3月25日	3月26日	3月27日
券		+0	+0
財政	+20,100	+7,200	▲4,000
過不足	+20,100	+6,700	▲4,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国債買入			+10,200
共通担保(全店)	▲4,800	+5,100	
CP等買入	▲800		▲700
社債等買入		+800	
ETF買入		+400	
国債補完供給	+900	▲100	+100
当座預金増減	+21,600	+16,300	▲4,000
当座預金残高	3,905,600	3,921,900	3,917,900
準備預金残高	3,414,400	主な需給要因	
積み終了先	3,413,000		
超過準備	3,412,600		
非準備預金残高	491,200	国債発行(40年)	
準備預金進捗率	99.6%		
平均	32.3%		
乖離率	67.3%		

3月25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(3/26~)						
1~3年	3,500	9,739	3,511	▲0.009	▲0.008	43.8
3~5年	4,000	10,953	4,005	▲0.013	▲0.012	87.0
10~25年	1,800	6,348	1,804	▲0.021	▲0.020	73.7
25年~	500	2,261	508	▲0.027	▲0.025	7.9
国債補完供給(3/25~3/26)						
	62,947	142	142	▲0.600	▲0.600	

マナタリーベース [億円]	所要 [億円]
3月22日時点 5,005,900	今積期の所要準備額 3,096,400
	3月26日以降の残り所要積数 12,500
	平均 600

国庫短期証券入札予定

4月3日	3ヶ月
4月5日	3ヶ月
4月9日	6ヶ月
4月12日	3ヶ月
3月26日	40年
3月28日	2年
4月2日	10年
4月4日	30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	3月20日	0
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25日	0
5年超10年以下	3,000~6,500 程度	4,800	6 13 20 29	3月20日	1
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25日	1
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。