

短期市場の推移

[億円] [%]

3月27日の予定(時刻は日本時間)

	3月19日	3月20日	3月22日	3月25日
加重平均金利	▲0.053	▲0.059	▲0.061	▲0.062
東京レポレート(ON)	▲0.104	▲0.107	▲0.127	▲0.136
無コール残	77,778	91,127	96,130	88,873
ON	57,033	68,202	66,125	58,158
その他	20,745	22,925	30,005	30,715
有コール残	18,290	19,192	14,039	13,964

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。

日本	予想	海外	予想
-	-	20:00	(米)MBA住宅ローン申請指数[前週比]
-	-	21:30	(米)1月貿易収支
-	-	23:00	(米)経常収支(10-12月)

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

[%]

平日の短期市場金利	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	▲0.064	▲0.148
T/N	-	-	▲0.020	▲0.167
S/N	-	-	-	-
1W	0.020	0.040	0.033	▲0.227
2W	-	-	-	▲0.168
3W	-	-	-	▲0.149
1M	-	-	▲0.025	▲0.145
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.144
6M	-	-	-	▲0.154
1Y	-	-	-	▲0.156

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▲0.075%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。同加重平均金利(速報)は、前営業日対比▲0.002%の▲0.064%と6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	▲0.086 ~ ▲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。

資金需給

[億円]

	日銀速報	日銀予想	当社需給予想
	3月26日	3月27日	3月28日
券	▲400	▲300	▲1,000
財政	+5,400	▲7,900	+21,000
過不足	+5,000	▲8,200	+20,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国庫短期証券買入	▲700	▲400	+300
国債買入	+10,200	-	-
CP等買入	-	-	-
ETF買入	-	-	-
国債補完供給	+100	-	-
当座預金増減	+14,600	▲3,300	+20,000
当座預金残高	3,920,200	3,916,900	3,936,900
準備預金残高	3,430,500	-	-
積み終了先	3,428,800	-	-
超過準備	3,428,800	-	-
非準備先残高	489,700	-	-
準備預金進捗率	99.7%	-	-
平均	35.5%	-	-
乖離率	64.2%	-	-

3月26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 按分

国庫短期証券買入(3/27~)
5,000 14,198 5,001 0.000 0.004 40.9

米ドル資金供給(3/28~4/4)
0 0 2,900 2,900

CP等買入(3/29~)
3,500 8,114 3,490 ▲0.009 ▲0.005 33.3

マネタリーベース[億円] 所要
3月25日時点 5,027,500 今積期の所要準備額 3,096,400

3月27日以降の残り所要
積数 10,800
平均 500

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

国債入札予定

3月28日	2年
4月2日	10年
4月4日	30年
4月9日	5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	4 8 18 25	3月25日	0
3年超5年以下	3,000~5,500 程度	4,000	6 13 20 29	3月20日	1
5年超10年以下	3,000~6,500 程度	4,800	4 13 25 29	3月25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	-	-	-
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。