

平成31年4月1日(月)

短期市場の推移

[億円] [%]

4月2日の予定 (時刻は日本時間)

	3月26日	3月27日	3月28日	3月29日
加重平均金利	▲0.064	▲0.066	▲0.067	▲0.060
東京レポレート(ON)	▲0.148	▲0.120	▲0.105	▲0.225
無コール残	89,570	89,588	85,566	41,283
ON	65,800	64,758	61,361	28,623
その他	23,770	24,830	24,205	12,660
有コール残	12,513	12,230	15,576	9,883

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。

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	▲0.067	▲0.089
T/N	-	-	-	▲0.085
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.040	▲0.015	▲0.033	▲0.086
2W	▲0.040	▲0.020	▲0.035	▲0.092
3W	▲0.020	0.000	▲0.013	▲0.105
1M	-	-	-	▲0.129
2M	-	-	0.000	-
3M	-	-	-	▲0.139
6M	-	-	-	▲0.155
1Y	-	-	-	▲0.157

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▲0.086%の出合から始まった。その後は▲0.086～▲0.025%の水準で取引された。前営業日より▲0.08%台の出合が増加し、同加重平均金利は前営業日対比▲0.007%の▲0.067%となった。

都銀・信託		証券	地銀
▲0.086 ~ ▲0.086		▲0.085 ~ ▲0.085	▲0.086 ~ ▲0.025

翌営業日のマーケット

ビッドサイドの調達姿勢は引き続き慎重で、本日と同様の軟調な地合いを予想する。

資金需給

[億円]

	日銀速報 4月1日	日銀予想 4月2日	当社需給予想 4月3日
券	+700	+500	+1,000
財政	▲27,100	▲20,400	▲17,000
過不足	▲26,400	▲19,900	▲16,000
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)	▲1,600	▲1,800	-
国債補完供給	+1,900	+300	-
当座預金増減	▲17,000	▲19,600	▲16,000
当座預金残高	3,923,300	3,903,700	3,887,700
準備預金残高	3,426,700	主な需給要因	
積み終了先	3,426,400	-	-
超過準備	3,426,400	-	-
非準備先残高	496,600	-	-
準備預金進捗率	99.9%	-	-
平均	54.8%	-	-
乖離率	45.1%	-	-

4月1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

国債補完供給(4/1~4/2)	55,175	306	306	▲0.600	▲0.600
-----------------	--------	-----	-----	--------	--------

マネタリーベース [億円]	所要 [億円]
3月29日時点 5,064,400	今積期の所要準備額 3,127,000
	4月2日以降の残り所要
	積数 2,100
	平均 200

国庫短期証券入札予定

4月3日	3ヶ月	第823回
4月5日	3ヶ月	第824回
4月9日	6ヶ月	
4月12日	3ヶ月	
国債入札予定		
4月2日	10年	
4月4日	30年	
4月9日	5年	
4月16日	20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	2
1年超3年以下	2,500~4,500 程度	3,500		3月25日	4
3年超5年以下	3,000~5,500 程度	4,000	3 12 19 24	3月29日	4
5年超10年以下	3,000~6,500 程度	4,800	3 10 17 26	3月29日	4
10年超25年以下	1,500~2,500 程度	1,800	8 12 19 24	3月29日	4
25年超	100~1,000 程度	500		3月29日	4
物価連動債	250 程度	250	月2回程度	3月18日	2
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。