

DAILY SIGNAL 上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

2020年2月17日(月)

短期市場の推移

[億円] [%]

	2月10日	2月12日	2月13日	2月14日
加重平均金利	▲0.010	▲0.008	▲0.008	▲0.011
東京レポレート(ON)	▲0.054	▲0.077	▲0.093	▲0.077
無コール残	90,381	84,793	89,837	85,069
ON	53,896	57,878	63,012	55,204
その他	36,485	26,915	26,825	29,865
有コール残	19,114	18,655	18,846	18,569

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	▲0.075	0.001	▲0.025	▲0.086
T/N	-	-	0.001	▲0.090
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.020	0.002	▲0.003	▲0.086
2W	-	-	▲0.010	▲0.085
3W	-	-	-	▲0.087
1M	-	-	▲0.010	▲0.092
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.102
6M	-	-	-	▲0.132
1Y	-	-	-	▲0.158

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

2月18日の予定(時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	22:30 (米)2月ニューヨーク連銀 製造業景気指数	5.0
-	-	(米)2月NAHB住宅市場 指数	-
-	-	-	-

経済指標及び予想値は株式会社フィスコ提供

本日の市況

本日の無担保コールON物は▲0.020%の出合から始まった。
その後は主に▲0.030%～▲0.010%の水準で取引された。
新積み期初日であったが、地銀業態を中心に調達ニーズが強く、
同加重平均金利(速報)は▲0.025%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.070 ~ ▲0.060	▲0.025 ~ ▲0.015	▲0.030 ~ ▲0.010

翌営業日のマーケット

地銀業態を中心とした調達ニーズは強く、堅調な地合が継続されると予想。

資金需給

[億円]

	日銀速報	日銀予想	当社需給予想
	2月17日	2月18日	2月19日
券	+500	+0	▲1,000
財政	+400	▲1,300	▲22,000
過不足	+900	▲1,300	▲23,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
CP等買入	▲200	-	-
ETF買入	+700	-	-
国債補完供給	+100	+100	-
当座預金増減	+1,400	▲1,200	▲23,000
当座預金残高	4,000,200	3,999,000	3,976,000
準備預金残高	3,472,800	主な需給要因	
積み終了先	3,387,100	-	-
超過準備	3,056,700	-	-
非準備先残高	527,400	-	-
準備預金進捗率	96.7%	国債発行(5年)	
平均	6.9%	-	-
乖離率	89.8%	-	-

2月17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(2/17~2/18)	71	71	▲0.350	▲0.350	-	-

マネタリーベース [億円]
2月14日時点 5,134,200

所要	[億円]
今積期の所要準備額	3,026,800
2月18日以降の残リ所要	-
積数	98,900
平均	3,700

国庫短期証券入札予定

2月19日	1年	第889回
2月21日	3ヶ月	第890回
2月28日	3ヶ月	-
3月6日	3ヶ月	-
国債入札予定	-	-
2月18日	5年	-
2月20日	20年	-
2月28日	2年	-
3月3日	10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	2月10日	1
1年超3年以下	3,000~5,500 程度	4,200	7 13 21 27	2月13日	2
3年超5年以下	2,000~4,500 程度	3,400	7 13 21 27	2月13日	2
5年超10年以下	2,000~5,000 程度	3,500	7 13 21 27	2月10日	1
10年超25年以下	500~2,000 程度	1,200	10 25	2月7日	1
25年超	0~500 程度	300	月2回程度	2月13日	0
物価連動債	300 程度	300	月1回	-	-
変動利付債<偶数月>	1,000 程度	1,000	-	-	-

1年前の市場推移

○2019年2月積み期 [2月15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。

上田八木短資株式会社 登録金融機関 近畿財務局長(登号)第243号 加入協会 日本証券業協会