

短期市場の推移

	2月12日	2月13日	2月14日	2月17日
加重平均金利	▲0.008	▲0.008	▲0.011	▲0.025
東京レポレート(ON)	▲0.077	▲0.093	▲0.077	▲0.086
無コール残	84,793	89,837	85,069	92,953
ON	57,878	63,012	55,204	63,993
その他	26,915	26,825	29,865	28,960
有コール残	18,655	18,846	18,569	18,037

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。

2月19日の予定(時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
8:50	1月貿易収支	-16,848億円	21:00	(米)MBA住宅ローン申請指数[前週比]
	-		22:30	(米)1月住宅着工件数
	-		22:30	(米)1月生産者物価コア指数[前年比]

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	▲0.075	0.001	▲0.018	▲0.102
T/N	-	-	0.001	▲0.098
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.005	0.002	▲0.004	▲0.089
2W	-	-	-	▲0.088
3W	-	-	▲0.002	▲0.089
1M	-	-	-	▲0.095
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.103
6M	-	-	-	▲0.134
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

本日の市況

本日の無担保コールON物は▲0.015%の出合から始まった。その後は主に▲0.015%~▲0.010%の水準で取引された。引き続き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)は前営業日対比+0.007%の▲0.018%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.060 ~ ▲0.060	▲0.015 ~ ▲0.015	▲0.015 ~ ▲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

	日銀速報	日銀予想	当社需給予想
	2月18日	2月19日	2月20日
券	+0	▲500	▲2,000
財政	+1,100	▲20,900	▲4,000
過不足	+1,100	▲21,400	▲6,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国庫短期証券買入		▲5,000	
CP等買入		▲100	
ETF買入		+600	
国債補完供給	+100	▲200	+200
当座預金増減	+1,000	▲15,700	▲6,000
当座預金残高	4,001,200	3,985,500	3,979,500
準備預金残高	3,475,100	主な需給要因	
積み終了先	3,446,200	国債発行(5年)	
超過準備	3,422,700	国庫短期証券発行・償還(1Y)	
非準預先残高	526,100		
準備預金進捗率	98.5%		
平均	10.3%		
乖離率	88.1%		

2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(2/19~)	5,000	16,263	5,005	0.005	0.006	53.7
CP等買入(2/21~)	3,500	10,525	3,480	▲0.001	0.000	37.2
国債補完供給(2/18~2/19)	207	207	▲0.350	▲0.350		

マナタリーベース [億円]
 2月17日時点 5,135,100

所要 [億円]
 今積期の所要準備額 3,026,800
 2月19日以降の残り所要積数 46,500
 平均 1,800

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	
2月20日	20年	
2月28日	2年	
3月3日	10年	
3月5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	2月10日	1
1年超3年以下	3,000~5,500 程度	4,200			
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13日	2
10年超25年以下	500~2,000 程度	1,200			
25年超	0~500 程度	300	10 25	2月10日	1
物価連動債	300 程度	300	月2回程度	2月7日	1
変動利付債<偶数月>	1,000 程度	1,000	月1回	2月13日	0

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。