

2020年2月20日(木)

短期市場の推移

[億円] [%]

	2月14日	2月17日	2月18日	2月19日
加重平均金利	▲0.011	▲0.025	▲0.018	▲0.017
東京レポレート(ON)	▲0.077	▲0.086	▲0.102	▲0.063
無コール残	85,069	92,953	94,548	97,614
ON	55,204	63,993	64,158	67,349
その他	29,865	28,960	30,390	30,265
有コール残	18,569	18,037	18,735	20,112

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	▲0.065	0.001	▲0.016	▲0.061
T/N	-	-	0.001	▲0.067
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.009	0.230	0.000	▲0.069
2W	-	-	▲0.010	▲0.073
3W	-	-	-	▲0.079
1M	-	-	-	▲0.090
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.102
6M	-	-	-	▲0.131
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

2月21日の予定(時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
8:30	1月消費者物価コア指数 [前年比]	+0.8%	23:45	(米)2月製造業購買部 担当者指数(PMI)	51.5
	-	-	23:45	(米)2月サービス業 購買部担当者指数 (PMI)	53.5
	-	-	-	(欧)1月消費者物価 (確報)	-

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▲0.015%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。
同加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.001%の▲0.016%となった。

[%]

都銀・信託	証券	地銀
▲0.050 ~ ▲0.050	▲0.015 ~ ▲0.010	▲0.015 ~ ▲0.010

翌営業日のマーケット

引き続き調達意欲は底堅く、週末4日積みとなることで、出合の水準は本日よりも上昇する見込み。

資金需給

[億円]

	日銀速報	日銀予想	当社需給予想
	2月20日	2月21日	2月25日
券	▲1,400	▲1,200	+0
財政	▲3,600	+4,400	+2,000
過不足	▲5,000	+3,200	+2,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
CP等買入	▲100	▲800	+3,500
社債等買入		▲100	
ETF買入			
国債補完供給	+100		
当座預金増減	▲4,900	+5,800	+2,000
当座預金残高	3,979,700	3,985,500	3,987,500
準備預金残高	3,446,400	主な需給要因	
積み終了先	3,437,700		
超過準備	3,437,200	国債発行(20年)	
非準備先残高	533,300		
準備預金進捗率	99.2%	国庫短期証券 発行・償還 (3M)	
平均	17.2%		
乖離率	82.0%		

2月20日のオペ結果 [円][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
社債等買入(2/27~)	1,000	2,541	1,000	0.033	0.053	1.7
国債補完供給(2/20~2/21)	0	0				
	1	1	▲0.350	▲0.350		

マネタリーベース [億円]
2月19日時点 5,120,200

所要 [億円]
今積期の所要準備額 3,026,800
2月21日以降の残リ所要
積数 23,300
平均 1,000

国庫短期証券入札予定

2月21日	3ヶ月	第890回
2月28日	3ヶ月	
3月6日	3ヶ月	
3月9日	6ヶ月	
国債入札予定		
2月28日	2年	
3月3日	10年	
3月5日	30年	
3月10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	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。