

# DAILY SIGNAL

上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

2020年2月21日(金)

短期市場の推移

[億円][%]

	2月17日	2月18日	2月19日	2月20日
加重平均金利	▲0.025	▲0.018	▲0.017	▲0.016
東京レポレート(ON)	▲0.086	▲0.102	▲0.063	▲0.061
無コール残	92,953	94,548	97,614	91,902
ON	63,993	64,158	67,349	60,387
その他	28,960	30,390	30,265	31,515
有コール残	18,037	18,735	20,112	20,482

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25日の予定(時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
		(米)1月シカゴ連銀全米活動指数	

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	▲0.078
T/N	-	-	▲0.005	▲0.077
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.010	0.002	▲0.004	▲0.078
2W	▲0.020	▲0.005	▲0.008	▲0.079
3W	-	-	-	▲0.083
1M	-	-	▲0.010	▲0.090
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.102
6M	-	-	-	▲0.133
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▲0.01%の出合から始まった。その後は主に▲0.010%~▲0.005%の水準で取引された。同加重平均金利(速報)は前営業日対比横ばいの▲0.016%となった。

都銀・信託	証券	地銀
- ~ -	▲ 0.010 ~ ▲ 0.010	▲ 0.065 ~ ▲ 0.003

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21日	2月25日	2月25日	2月26日	2月26日	2月26日
券	▲1,300	▲100	▲100	▲1,000	▲1,000	▲1,000
財政	+5,400	▲800	▲800	+2,000	+2,000	+2,000
過不足	+4,100	▲900	▲900	+1,000	+1,000	+1,000
金融調節	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド	スタート
国債買入				+11,500		
共通担保(全店)			▲5,800	+7,000		
CP等買入	▲800	+3,500	▲200			
社債等買入	▲100		▲100			
国債補完供給		▲100	+100			
当座預金増減		+6,600	+11,600	+1,000	+1,000	+1,000
当座預金残高		3,986,300	3,997,900	3,998,900	3,998,900	3,998,900
準備預金残高		3,460,800				
積み終了先		3,459,000				
超過準備		3,456,800				
非準備預金残高		525,500				
準備預金進捗率		99.8%				
平均		31.0%				
乖離率		68.7%				

2月21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
国債買入(2/25~)						
1~3年	4,200	17,029	4,203	▲0.008	▲0.006	56.1
3~5年	3,400	10,283	3,401	▲0.011	▲0.008	72.5
5~10年	3,500	8,177	3,502	▲0.018	▲0.014	37.8
国債補完供給(2/21~2/25)			59	59	▲0.350	▲0.350
共通担保(全店)(2/25~3/16)			15,000	7,021		

マナタリーベース [億円]	所要 [億円]
2月20日時点 5,116,600	今積期の所要準備額 3,026,800
	2月25日以降の残り所要積数 7,200
	平均 400

国庫短期証券入札予定

2月28日	3ヶ月	第891回
3月6日	3ヶ月	
3月9日	6ヶ月	
3月13日	3ヶ月	
2月28日	2年	
3月3日	10年	
3月5日	30年	
3月10日	5年	

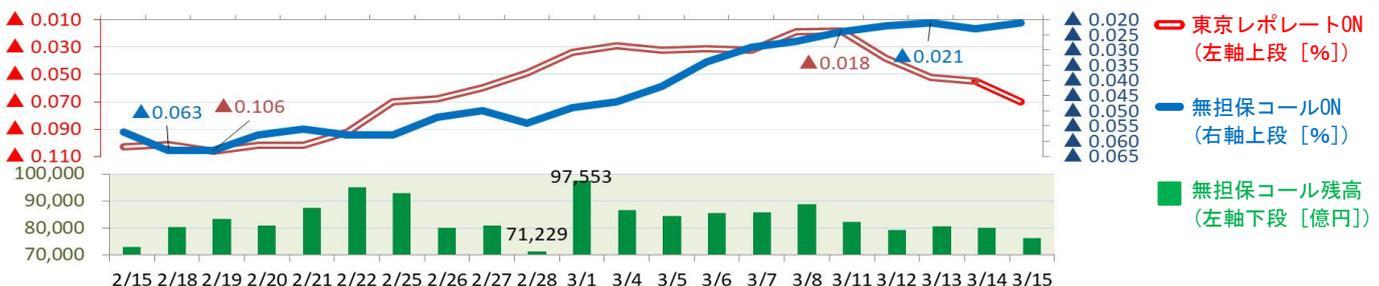
今月の国債買入オペ予定

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			
3年超5年以下	2,000~4,500 程度	3,400	7 13 21 27	2月21日	1
5年超10年以下	2,000~5,000 程度	3,500	7 13 21 27	2月21日	1
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	#VALUE!

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