

DAILY SIGNAL 上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

2020年2月25日(火)

短期市場の推移

[億円] [%]

	2月18日	2月19日	2月20日	2月21日
加重平均金利	▲0.018	▲0.017	▲0.016	▲0.016
東京レポレート(ON)	▲0.102	▲0.063	▲0.061	▲0.078
無コール残	94,548	97,614	91,902	111,697
ON	64,158	67,349	60,387	79,574
その他	30,390	30,265	31,515	32,123
有コール残	18,735	20,112	20,482	20,356

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26日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
		21:00	(米)MBA住宅ローン申請指数[前週比]

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

本日の市況

	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	▲0.012	▲0.085
T/N	▲0.025	0.001	▲0.012	▲0.080
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.020	0.002	▲0.011	▲0.080
2W	-	-	▲0.005	▲0.081
3W	-	-	-	▲0.085
1M	-	-	0.005	▲0.091
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.103
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

本日の無担保コールON物は▲0.01%の出合から始まり、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+0.004%の▲0.012%となった。なお、2月21日の無担保コール市場残高は2008年11月以来、約11年3か月ぶりの11兆円台となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.025 ~ ▲0.020	- ~ -	▲0.010 ~ ▲0.005

翌営業日のマーケット

引き続き調達意欲は強く、本日と同様の堅調になると予想。

資金需給

[億円]

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	2月25日	2月26日	2月26日	2月27日	2月27日	2月28日
券	▲400	▲400	▲400	▲1,000		
財政	+100	▲400	▲400	▲4,000		
過不足	▲300	▲800	▲800	▲5,000		
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		+2,600		
共通担保(全店)	▲5,800	+7,000				
CP等買入	▲200		▲300			
社債等買入	▲100					
国債補完供給	+100	▲100	+100			+1,000
当座預金増減		+12,100		+1,600		▲4,000
当座預金残高		3,998,400		4,000,000		3,996,000
準備預金残高		3,481,700		主な需給要因		
積み終了先		3,480,900				
超過準備		3,480,900				
非準預先残高		516,700				
準備預金進捗率		99.8%				
平均		34.5%				
乖離率		65.3%				

2月25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(2/26~)						
~1年	500	1,921	501	0.006	0.012	35.3
10~25年	1,200	3,511	1,204	▲0.017	▲0.013	88.5
25年~	300	1,314	306	▲0.007	▲0.007	90.1
物価連動	300	1,588	301	0.000	▲0.036	27.6
米ドル資金供給(2/27~3/5)						
1			1	2.080	2.080	
国債補完供給(2/25~2/26)						
115		115	▲0.350	▲0.350		

マナタリーベース [億円]	所要 [億円]
2月21日時点 5,124,600	今積期の所要準備額 3,026,800
	2月26日以降の残り所要積数 6,400
	平均 300

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25日	0
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25日	0
物価連動債	300 程度	300	月2回程度	2月25日	0
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。