

# DAILY SIGNAL 上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

2020年2月26日(水)

## 短期市場の推移

	2月19日	2月20日	2月21日	2月25日
加重平均金利	▲0.017	▲0.016	▲0.016	▲0.012
東京レポレート(ON)	▲0.063	▲0.061	▲0.078	▲0.085
無コール残	97,614	91,902	111,697	100,310
ON	67,349	60,387	79,574	67,617
その他	30,265	31,515	32,123	32,693
有コール残	20,112	20,482	20,356	19,390

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27日の予定(時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
10:30 【挨拶】片岡審議委員(滋賀)	-	22:30 (米)10-12月期国内総生産(GDP)改定値[前期比年率]	2.2%
14:00 【挨拶】両宮副総裁(決済の未来フォーラム)	-	22:30 (米)1月耐久財受注[前月比]	-1.5%
-	-	22:30 (米)新規失業保険申請件数[前週分]	-

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	▲0.080	0.001	▲0.014	▲0.081
T/N	-	-	-	▲0.081
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	-	▲0.082
2W	-	-	0.000	▲0.081
3W	-	-	-	▲0.086
1M	0.020	0.300	0.160	▲0.091
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.104
6M	-	-	-	▲0.134
1Y	-	-	-	▲0.159

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▲0.015%~▲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▲0.002%の▲0.014%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.025 ~ ▲0.015	▲0.020 ~ ▲0.010	▲0.010 ~ ▲0.005

## 翌営業日のマーケット

引き続き調達意欲は底堅く、出合の水準は本日と同程度と予想する。

## 資金需給

	日銀速報 2月26日	日銀予想 2月27日	当社需給予想 2月28日
券	▲400	▲1,500	▲500
財政	▲1,100	▲6,100	+4,700
過不足	▲1,500	▲7,600	+4,200
金融調節	エンド	スタート	エンド
国庫短期証券買入			+7,500
国債買入	+2,600		
CP等買入	▲300	▲200	
社債等買入		+1,000	
国債補完供給	+100		
当座預金増減	+900	+700	+4,200
当座預金残高	3,999,300	4,000,000	4,004,200
準備預金残高	3,482,800	主な需給要因	
積み終了先	3,482,100		
超過準備	3,482,100		
非準預先残高	516,500		
準備預金進捗率	99.8%		
平均	37.9%		
乖離率	61.9%		

## 2月26日のオペ結果 [%(億ドル)] ※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(2/27~)	7,500	19,369	7,501	▲0.007	▲0.001	98.6
国債補完供給(2/26~2/27)			15	▲0.350	▲0.350	

マナタリーベース [億円]  
2月25日時点 5,137,100

所要	所要準備額
今積期の所要準備額	3,026,800
2月27日以降の残り所要積数	5,800
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。