

2020年2月28日(金)

短期市場の推移

[億円] [%]

	2月21日	2月25日	2月26日	2月27日
加重平均金利	▲0.016	▲0.012	▲0.014	▲0.014
東京レポレート(ON)	▲0.078	▲0.085	▲0.081	▲0.081
無コール残	111,697	100,310	100,119	98,965
ON	79,574	67,617	69,611	68,152
その他	32,123	32,693	30,508	30,813
有コール残	20,356	19,390	21,764	20,243

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	▲0.085	0.001	▲0.025	▲0.075
T/N	-	-	-	▲0.065
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.001	0.000	0.000	▲0.067
2W	-	-	-	▲0.069
3W	-	-	0.005	▲0.077
1M	-	-	0.002	▲0.093
2M	-	-	-	-
3M	-	-	0.002	▲0.103
6M	-	-	-	▲0.134
1Y	-	-	-	▲0.160

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

3月2日の予定(時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
13:00	日銀当座預金増減要因と金融調節(2月実績)	-	(米)2月製造業PMI(確報)	
	-		(米)2月ISM製造業指数	
	-		(欧)2月製造業PMI	

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▲0.025%~▲0.005%の水準で取引された。月末のため調達を控える先もあり同加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.01の▲0.025%となった。共通担保オペ(全店貸付・固定金利方式)2W物15,000億円がオファーされ、応札額は3,070億円となった。

[%]

都銀・信託	証券	地銀
▲0.045 ~ ▲0.040	▲0.015 ~ ▲0.015	▲0.020 ~ ▲0.005

翌営業日のマーケット

調達を控えていた先が戻ってくる見込みであり、出合いの水準は上昇すると予想。

資金需給

[億円]

	日銀速報	日銀予想	当社需給予想
	2月28日	3月2日	3月3日
券	+0	+400	+1,000
財政	+8,000	▲37,700	▲3,000
過不足	+8,000	▲37,300	▲2,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国債買入	+11,300		スタート
共通担保(全店)		+3,100	
CP等買入	▲900	▲200	
社債等買入	▲500		
ETF買入	+100	+200	
国債補完供給	+1,100	▲200	
当座預金増減	+18,900	▲34,000	▲2,000
当座預金残高	4,018,400	3,984,400	3,982,400
準備預金残高	3,494,800	主な需給要因	
積み終了先	3,494,400		
超過準備	3,494,400	国庫短期証券	
非準備先残高	523,600	発行・償還(3M)	
準備預金進捗率	99.9%	国債発行(2年)	
平均	51.7%		
乖離率	48.1%		

2月28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	按分
国債補完供給(2/28~3/2)	228	228	▲0.350	▲0.350		
共通担保(全店)(3/2~3/16)	15,000	3,070	3,070			

マネタリーベース [億円]
2月27日時点 5,139,900

所要 [億円]
今積期の所要準備額 3,026,800
3月2日以降の残リ所要
積数 4,000
平均 300

国庫短期証券入札予定

3月6日	3ヶ月	第892回
3月9日	6ヶ月	
3月13日	3ヶ月	
3月17日	1年	
国債入札予定		
3月3日	10年	
3月5日	30年	
3月10日	5年	
3月12日	20年	

来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	2
1年超3年以下	3,000~5,500 程度	4,200		2月27日	4
3年超5年以下	2,000~4,500 程度	3,400	4 9 18 27	2月27日	4
5年超10年以下	2,000~5,000 程度	3,500	6 11 18 27	2月27日	4
10年超25年以下	500~2,000 程度	1,200	9 23	2月25日	2
25年超	0~500 程度	300		2月25日	2
物価連動債	300 程度	300	月2回程度	2月25日	2
変動利付債<偶数月>	1,000 程度	1,000	-	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。