

短期市場の推移

	2月12日	2月13日	2月14日	2月15日
加重平均金利	▲0.049	▲0.051	▲0.052	▲0.057
東京レポレート(ON)	▲0.088	▲0.087	▲0.082	▲0.103
無コール残	78,572	86,108	78,820	73,092
ON	48,747	56,773	51,985	50,427
その他	29,825	29,335	26,835	22,665
有コール残	26,993	30,538	31,439	18,783

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19日の予定(時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	18:00 (欧)12月経常収支	-
-	-	18:30 (英)1月失業率	-
-	-	18:30 (英)12月ILO失業率(3カ月)	4.0%

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	▲0.086	0.001	▲0.063	▲0.101
T/N	-	-	▲0.020	▲0.117
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.040	0.001	▲0.026	▲0.123
2W	▲0.040	▲0.010	▲0.031	▲0.128
3W	-	-	-	▲0.131
1M	-	-	-	▲0.141
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.164
6M	-	-	-	▲0.165
1Y	-	-	-	▲0.164

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

積み初日となる本日の無担保コールON物は▲0.065%の出合から始まり、その後は主に▲0.086~▲0.025%の水準で出合が見られた。同加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.006%の▲0.063%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.086 ~ ▲0.085	▲0.075 ~ ▲0.075	▲0.085 ~ ▲0.025

翌営業日のマーケット

本日と同様にビッドサイドは慎重な調達姿勢となると予想する。

資金需給

	日銀速報 2月18日	日銀予想 2月19日	当社需給予想 2月20日
券	+500	▲100	▲1,000
財政	▲8,100	+5,100	▲20,000
過不足	▲7,600	+5,000	▲21,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国債買入			+10,100
共通担保(全店)	▲700	+700	
CP等買入	▲200	+2,000	▲100
国債補完供給	+200	▲100	+100
当座預金増減	▲5,700	+15,100	▲21,000
当座預金残高	3,841,400	3,856,500	3,835,500
準備預金残高	3,351,700	主な需給要因	
積み終了先	3,326,300	国庫短期証券発行・償還(1Y)	
超過準備	3,303,700	国債発行(20年)	
非準備先残高	489,700		
準備預金進捗率	98.4%		
平均	10.7%		
乖離率	87.6%		

2月18日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	接分
国債買入(2/19~)						
1~3年	3,500	9,632	3,508	▲0.004	▲0.003	17.8
3~5年	4,000	11,705	4,007	▲0.008	▲0.007	94.3
10~25年	1,800	4,708	1,808	0.002	0.002	94.9
25年~	500	2,374	504	▲0.001	▲0.001	95.3
国債補完供給(2/18~2/19)						
	42,719	43	43	▲0.600	▲0.600	
	20,000	9	9	▲0.600	▲0.600	

マナタリーベース [億円]
2月15日時点 4,960,300

所要 [億円]
今積期の所要準備額 2,820,500
2月19日以降の残り所要積数 46,400
平均 1,900

国庫短期証券入札予定

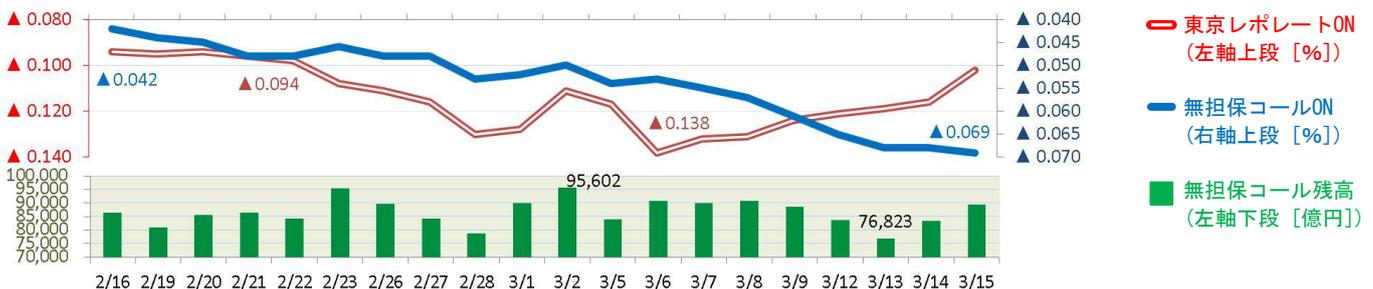
2月19日	1年	第815回
2月22日	3ヶ月	第816回
3月1日	3ヶ月	
3月7日	6ヶ月	
2月19日	20年	
2月28日	2年	
3月5日	10年	
3月7日	30年	

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14日	0
1年超3年以下	2,500~4,500 程度	3,500			
3年超5年以下	3,000~5,500 程度	4,000	4 6 18 27	2月18日	1
5年超10年以下	3,000~6,000 程度	4,300	6 8 14 22 27	2月14日	2
10年超25年以下	1,500~2,500 程度	1,800			
25年超	100~1,000 程度	500	4 12 18 22	2月18日	1
物価連動債	250 程度	250	月2回程度	2月6日	1
変動利付債<偶数月>	1,000 程度	1,000	1回	2月14日	0

1年前の市場推移 ○2018年2月積み期 [2月16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。