

短期市場の推移

[億円] [%]

	2月14日	2月15日	2月18日	2月19日
加重平均金利	▲0.052	▲0.057	▲0.063	▲0.063
東京レポレート(ON)	▲0.082	▲0.103	▲0.101	▲0.106
無コール残	78,820	73,092	80,256	83,490
ON	51,985	50,427	53,741	56,725
その他	26,835	22,665	26,515	26,765
有コール残	31,439	18,783	23,491	17,667

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	▲0.086	0.001	▲0.058	▲0.102
T/N	-	-	▲0.020	▲0.111
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.030	0.001	▲0.023	▲0.118
2W	▲0.040	▲0.012	▲0.023	▲0.124
3W	-	-	-	▲0.127
1M	-	-	▲0.025	▲0.139
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.162
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

2月21日の予定(時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
2月の月例経済報告		18:00	(欧)2月購買担当者総合指数(PMI)
-		23:45	(米)2月製造業PMI
-		23:45	(米)2月サービス業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▲0.060%の出合から始まった。その後は主に▲0.080～▲0.025%の水準で出合が見られた。地銀業態を中心に調達意欲が昨日対比でやや強まり、同加重平均金利(速報)は、前営業日対比+0.005%の▲0.058%となった。

業態別出合レンジ

[%]

都銀・信託	証券	地銀
▲0.080 ~ ▲0.080	▲0.080 ~ ▲0.050	▲0.080 ~ ▲0.025

翌営業日のマーケット

本日と同様の地合が継続し、出合水準は横ばい圏と予想する。

資金需給

[億円]

	日銀速報	日銀予想	当社需給予想
	2月20日	2月21日	2月22日
券	▲600	▲1,500	▲1,000
財政	▲19,500	▲700	▲3,000
過不足	▲20,100	▲2,200	▲4,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
CP等買入	▲100	▲100	
社債等買入		▲200	
ETF買入		+600	
当座預金増減	▲20,200	▲1,900	▲4,000
当座預金残高	3,833,400	3,831,500	3,827,500
準備預金残高	3,336,800	主な需給要因	
積み終了先	3,328,800		
超過準備	3,327,100		
非準備預金残高	496,600		
準備預金進捗率	99.4%		
平均	17.9%		
乖離率	81.6%		

2月20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
米ドル資金供給(2/22～2/28)		3	3	2,900	2,900	
国債補完供給(2/20～2/21)	20,000	33	33	▲0.600	▲0.600	

マネタリーベース [億円]
2月19日時点 4,966,400

所要 [億円]
今積期の所要準備額 2,820,500
2月21日以降の残リ所要
積数 16,200
平均 700

国庫短期証券入札予定

2月22日	3ヶ月	第816回
3月1日	3ヶ月	
3月7日	6ヶ月	
3月8日	3ヶ月	

国債入札予定

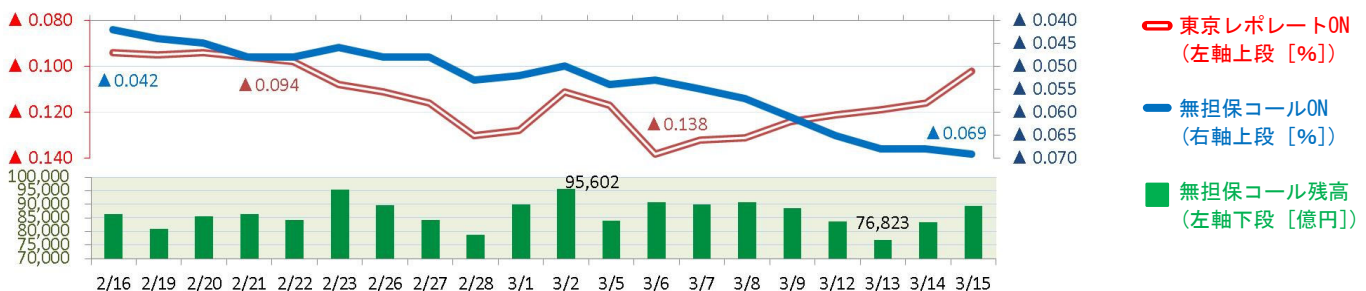
2月28日	2年	
3月5日	10年	
3月7日	30年	
3月12日	5年	

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 8 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	4 12 18 22	2月18日	1
25年超	100～1,000 程度	500			
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。