

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	▲0.063	▲0.063	▲0.058	▲0.056
東京レポレート(ON)	▲0.101	▲0.106	▲0.102	▲0.102
無コール残	80,256	83,490	80,994	87,432
ON	53,741	56,725	54,549	60,677
その他	26,515	26,765	26,445	26,755
有コール残	23,491	17,667	26,611	27,998

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25日の予定 (時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
8:50	企業向けサービス 価格指数(1月)	-	22:30	(米)1月シカゴ連銀 全米活動指数	-
	-			-	
	-			-	

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	▲0.086	0.001	▲0.058	▲0.092
T/N	-	-	▲0.020	▲0.087
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.040	▲0.013	▲0.030	▲0.098
2W	▲0.040	▲0.005	▲0.025	▲0.106
3W	-	-	-	▲0.115
1M	-	-	-	▲0.128
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.158
6M	-	-	-	▲0.164
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~▲0.020%の水準で出合が見られた。週末3日積みではあったものの、出合水準は概ね昨日と横ばいだった。
同加重平均金利(速報)は、前営業日対比▲0.002%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 ~ ▲0.080	▲0.080 ~ ▲0.020

翌営業日のマーケット

本日同様、横ばい圏での出合を予想する。

資金需給

[億円]

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	2月22日	2月25日	2月22日	2月25日	2月26日	2月26日
券	▲1,200	▲200	▲1,200	▲200	▲1,000	▲1,000
財政	+800	+900	+800	+900	+1,000	+1,000
過不足	▲400	+700	▲400	+700	+0	+0
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
国庫短期証券買入		+5,000				
国債買入				+7,200		
共通担保(全店)			▲3,300	+4,900		
CP等買入	▲300		▲300			
社債等買入				+500		
ETF買入				+100		
当座預金増減		+4,300		+9,800		+0
当座預金残高		3,835,000		3,844,800		3,844,800
準備預金残高		3,352,600				
積み終了先		3,352,200				
超過準備		3,350,800				
非準備先残高		482,400				
準備預金進捗率		99.8%				
平均		32.1%				
乖離率		67.7%				

2月22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(2/25~)						
5~10年	4,300	10,779	4,304	▲0.005	▲0.003	41.8
10~25年	1,800	4,164	1,802	▲0.007	▲0.003	38.7
25年~	500	1,655	507	0.006	0.006	87.4
物価連動	250	1,287	251	▲0.020	▲0.076	100.0
国債補完供給(2/22~2/25)						
20,000		40	40	▲0.600	▲0.600	
10,000		2	2	▲0.600	▲0.600	
共通担保(全店)(2/25~3/11)						
8,000		4,916	4,916			

マナタリーベース [億円]
2月21日時点 4,945,600

所要 [億円]
今積期の所要準備額 2,820,500
2月25日以降の残り所要
積数 4,900
平均 300

国庫短期証券入札予定

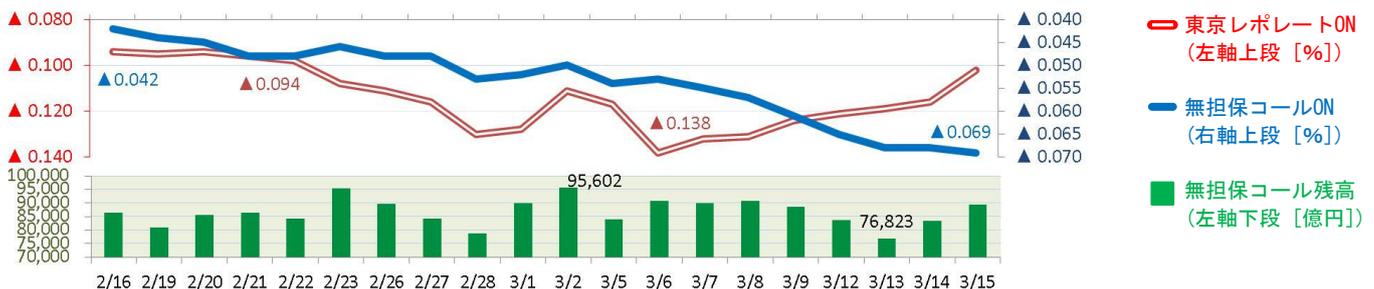
今月の国債買入オペ予定

3月1日	3ヶ月	第817回
3月7日	6ヶ月	
3月8日	3ヶ月	
3月14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	

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22日	1
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22日	0
物価連動債	250 程度	250	月2回程度	2月22日	0
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。