

短期市場の推移

[億円] [%]

	2月21日	2月22日	2月25日	2月26日
加重平均金利	▲0.056	▲0.058	▲0.058	▲0.052
東京レポレート(ON)	▲0.102	▲0.092	▲0.070	▲0.068
無コール残	87,432	95,105	92,838	80,063
ON	60,677	59,120	56,743	53,823
その他	26,755	35,985	36,095	26,240
有コール残	27,998	30,749	24,765	22,888

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28日の予定(時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
8:50	1月鉱工業生産指数 [前月比]	▲2.5%	22:30 (米)10-12月期国内総生産(GDP)[前期比年率]	2.5%
10:30	【挨拶】鈴木審議委員 (茨城)	-	(米)FRB議長講演	
-	【記者会見】 片岡審議委員(2月27日)	-	(米)ダラス連銀総裁講演	

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	▲0.050	▲0.060
T/N	-	-	▲0.020	▲0.059
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.025	0.001	▲0.020	▲0.067
2W	▲0.020	▲0.010	▲0.020	▲0.075
3W	-	-	-	▲0.089
1M	-	-	▲0.050	▲0.102
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.148
6M	-	-	-	▲0.160
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

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。一部ビッドサイドの調達意欲が強く、同加重平均金利(速報)は、前営業日対比+0.002%の▲0.050%となった。

業態別出合レンジ

[%]

都銀・信託	証券	地銀
▲0.086 ~ ▲0.080	▲0.085 ~ ▲0.080	▲0.080 ~ ▲0.025

翌営業日のマーケット

月末であるため一部金融機関が調達を見合わせる見込みであり、出合水準が若干低下すると予想する。

資金需給

[億円]

	日銀速報	日銀予想	当社需給予想
	2月27日	2月28日	3月1日
券	▲1,000	▲1,100	▲1,000
財政	▲8,800	+5,300	▲21,000
過不足	▲9,800	+4,200	▲22,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国庫短期証券買入		+2,500	
国債買入			+12,000
CP等買入	▲200	▲1,800	+2,000
社債等買入	▲100		
ETF買入			+700
国債補完供給	+100	+100	
当座預金増減	▲7,600	+17,200	▲22,000
当座預金残高	3,838,500	3,855,700	3,833,700
準備預金残高	3,359,700	主な需給要因	
積み終了先	3,359,400		
超過準備	3,359,300		
非準備先残高	478,800		
準備預金進捗率	99.9%		
平均	42.9%		
乖離率	57.0%		
		国債発行(2年)	

2月27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
国債買入(2/28~)						
1~3年	3,500	13,579	3,503	0.003	0.005	28.4
3~5年	4,000	16,799	4,005	▲0.002	▲0.001	34.4
5~10年	4,300	13,735	4,312	▲0.004	▲0.003	23.6
国債補完供給(2/27~2/28)						
	13,985	69	69	▲0.600	▲0.600	

マネタリーベース [億円]
2月26日時点 4,963,500

所要 [億円]
今積期の所要準備額 2,820,000
2月28日以降の残り所要
積数 3,300
平均 200

国庫短期証券入札予定

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	

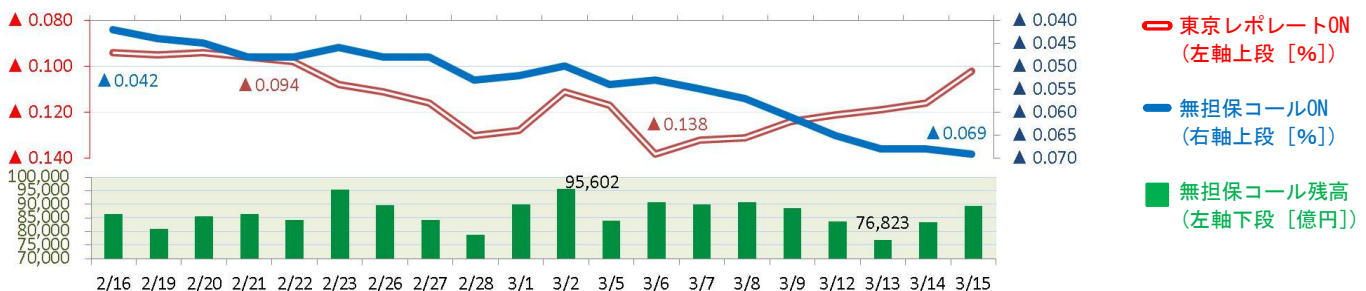
今月の国債買入オペ予定

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27日	0
5年超10年以下	3,000~6,000 程度	4,300	6 8 14 22 27	2月27日	0
10年超25年以下	1,500~2,500 程度	1,800	4 12 18 22	2月22日	0
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。