



短期市場の推移

	2月16日	2月17日	2月18日	2月19日
加重平均金利	▲0.021	▲0.022	▲0.022	▲0.019
東京レボレート(TN)	▲0.089	▲0.095	▲0.091	▲0.087
無コール残	114,899	116,889	110,927	137,797
ON	70,936	69,406	62,614	81,924
その他	43,963	47,483	48,313	55,873
有コール残	20,414	19,848	19,960	20,589

加重平均金利・コール残高は日銀、東京レボ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)	レボ市場
	最低 最高 平均	東京レボレート
O/N	▲0.060 0.001 ▲0.020	▲0.084
T/N	▲0.015 ▲0.001 ▲0.005	▲0.090
S/N	▲0.010 ▲0.007 ▲0.009	-
1W	▲0.010 ▲0.005 ▲0.008	▲0.091
2W	▲0.008 0.050 0.005	▲0.093
3W	- - -	▲0.094
1M	▲0.001 0.001 0.000	▲0.099
2M	- - -	-
3M	- - -	▲0.102
6M	- - -	▲0.112
1Y	- - -	▲0.139

無担保コール(速報)は日銀、東京レボレートは日本証券業協会公表

資金需給

	日銀速報	日銀予想	当社需給予想
	2月22日	2月24日	2月25日
券	▲900	▲600	▲1,000
財政	▲34,200	▲300	▲6,000
過不足	▲35,100	▲900	▲7,000
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			+15,000
国債買入	+12,300	+2,300	
共通担保(全店)			▲3,600
CP等買入	▲300	▲500	
社債等買入	+1,500		
国債補完供給	+100 ▲200	+200	
当座預金増減	▲21,700	+16,100	▲10,600
当座預金残高	4,913,800	4,929,900	4,919,300
準備預金残高	4,329,100	主な需給要因	
積み終了先	4,328,800	国庫短期証券発行・償還 (6M)	
超過準備	4,328,600		
非準備先残高	584,700		
準備預金進捗率	99.9%		
平均	28.6%		
乖離率	71.3%		

2月22日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
国庫短期証券買入(2/24~)	15,000	43,600	15,003	0.002	0.003	24.3
国債買入(2/24~)						
10~25年	1,200	5,602	1,203	0.014	0.015	43.9
25年~	300	1,572	301	0.015	0.015	97.7
変動利付	500	1,016	500	▲0.410	▲0.499	60.0
物価連動	300	1,675	303	▲0.160	▲0.183	86.8
CP等買入(2/26~)	5,000	7,287	4,992	▲0.036	▲0.031	66.7
国債補完供給(2/22~2/24)						
211	211	▲0.350	▲0.366			
1	1	▲0.350	▲0.350			

マネタリーベース [億円]

2月19日時点 6,140,100

所要

今積期の所要準備額	3,263,100
2月24日以降の残り所要	
積数	2,500
平均	100

国庫短期証券入札予定

2月24日	6ヶ月	第975回
2月26日	3ヶ月	第976回
3月5日	3ヶ月	
3月9日	6ヶ月	

国債入札予定

2月26日	2年
3月2日	10年
3月4日	30年
3月9日	5年

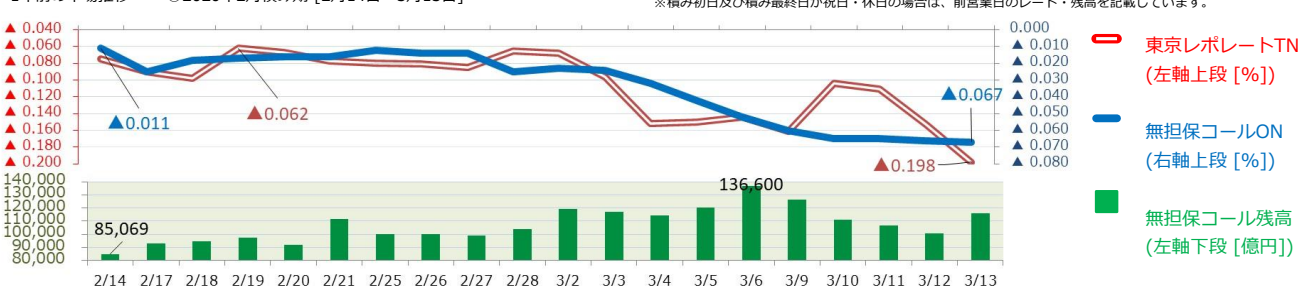
今月の国債買入オペ予定

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	500~1,500	1,000	月2回程度	2月5日	1
1年超3年以下	2,500~5,500	4,000	3 9 15 19 25	2月19日	1
3年超5年以下	2,000~5,500	3,700	3 9 15 19 25	2月19日	1
5年超10年以下	2,500~6,000	4,200	5 9 15 19 25	2月19日	1
10年超25年以下	500~2,000	1,200	5 22	2月22日	0
25年超	0~500	300	9 22	2月22日	0
物価連動債	300	300	月2回程度	2月22日	0
変動利付債<偶数月>	500	500	月1回	2月22日	0

1年前の市場推移

○2020年2月積み期 [2月14日~3月13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。

上田八木短資株式会社 登録金融機関 近畿財務局長(登金)第243号 加入協会 日本証券業協会