

DAILY SIGNAL

上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

平成31年2月25日(月)

短期市場の推移

[億円] [%]

	2月19日	2月20日	2月21日	2月22日
加重平均金利	▲0.063	▲0.058	▲0.056	▲0.058
東京レポレート(ON)	▲0.106	▲0.102	▲0.102	▲0.092
無コール残	83,490	80,994	87,432	95,105
ON	56,725	54,549	60,677	59,120
その他	26,765	26,445	26,755	35,985
有コール残	17,667	26,611	27,998	30,749

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26日の予定(時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
14:00	基調的なインフレ率を捕捉するための指標	22:30	(米)12月住宅着工件数 125.3万戸
			(米)FRB議長の 上院銀行委議会証言
			(英)中銀総裁の 議会証言

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	▲0.058	▲0.070
T/N	-	-	▲0.020	▲0.068
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.040	0.001	▲0.030	▲0.081
2W	▲0.030	0.000	▲0.017	▲0.087
3W	-	-	▲0.020	▲0.097
1M	-	-	▲0.020	▲0.112
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.154
6M	-	-	-	▲0.162
1Y	-	-	-	▲0.161

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。同加重平均金利(速報)は、前営業日対比横ばいの▲0.058%となった。

業態別出合レンジ

[%]

都銀・信託	証券	地銀
▲0.085 ~ ▲0.080	▲0.080 ~ ▲0.040	▲0.083 ~ ▲0.025

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25日	2月26日	2月26日	2月27日	2月27日	2月27日
券		▲400		▲800		▲1,000
財政		+4,100		+3,000		+3,000
過不足		+3,700		+2,200		+2,000
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
国債買入		+7,200				
共通担保(全店)	▲3,300	+4,900				
CP等買入	▲300		▲200			
社債等買入		+500				
ETF買入		+100		+700		
国債補完供給		▲400	+400			
当座預金増減		+12,400	+3,100		+2,000	
当座預金残高		3,847,400	3,850,500		3,852,500	
準備預金残高		3,371,000	主な需給要因			
積み終了先		3,370,500				
超過準備		3,370,400				
非準備預金残高		476,400				
準備預金進捗率		99.8%				
平均		35.7%				
乖離率		64.1%				

2月25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
CP等買入(2/28~)	2,000	6,913	1,973	▲0.001	0.005	31.5
国債補完供給(2/25~2/26)	21,000	362	362	▲0.600	▲0.600	

マナタリーベース [億円]
2月22日時点 4,951,100

所要	所要準備額
今積期の所要準備額	2,820,500
2月26日以降の残り所要積数	4,300
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	
2月28日	2年	
3月5日	10年	
3月7日	30年	
3月12日	5年	

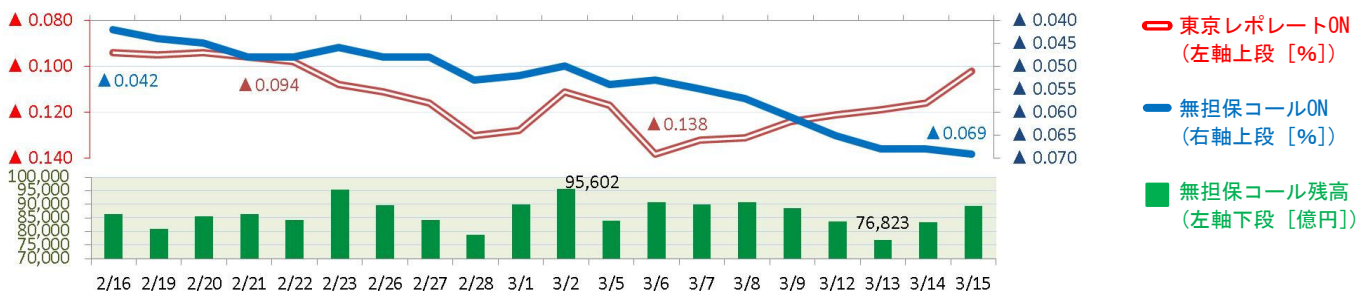
今月の国債買入オペ予定

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 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。