



デイリーシグナル

2025年2月27日(木)

短期市場の推移 [億円] [%]

	2月20日	2月21日	2月25日	2月26日
加重平均金利	0.477	0.478	0.479	0.477
東京レポレート(TN)	0.486	0.496	0.491	0.474
無コール残	80,758	81,804	84,955	82,486
ON	35,269	36,345	36,651	33,912
その他	45,489	45,459	48,304	48,574
有コール残	36,810	36,897	37,803	38,277

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	0.450	0.525	0.477	0.478
T/N	-	-	-	0.439
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	0.530	0.441
2W	-	-	0.530	0.439
3W	-	-	-	0.437
1M	0.540	0.700	0.567	0.434
2M	-	-	-	-
3M	-	-	0.640	0.458
6M	-	-	-	0.493
1Y	-	-	-	0.586

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28日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
鉱工業生産 (1月)		(米) シカゴPMI (2月)	
-		(米) 個人消費支出 (1月)	
-		-	

本日の市況

無担保コールON物は0.477%の出合から始まり、その後は同程度で推移した。ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比横ばいの0.477%となった。

都銀・信託	証券	地銀
- ~ -	0.477 ~ 0.477	0.477 ~ 0.477

翌営業日のマーケット

出合の水準は本日対比横ばい圏を予想する。

資金需給 [億円]

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	2月27日	2月28日	2月28日	3月3日	3月3日	3月3日
券	▲400		+400		+0	
財政	+2,000		+7,800		▲32,000	
過不足	+1,600		+8,200		▲32,000	
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		+8,200				
CP等買入	▲100		▲500			
社債等買入			▲200			
国債補完供給	+5,000	▲7,300	+7,300			
成長基盤強化支援					▲6,800	
当座預金増減	+7,400		+14,800		▲38,800	
当座預金残高	5,318,700		5,333,500		5,294,700	
準備預金残高	4,842,800		主な需給要因			
積み終了先	4,841,900		国庫短期証券発行償還 (3M)			
超過準備	4,841,900		国債発行償還 (2年)			
非準備先残高	475,900					
準備預金進捗率	99.9%					
平均	42.9%					
乖離率	57.0%					

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
国債補完供給(2/27~2/28)	7,566	7,566	0.250	0.250		
	0	0				

マネタリーベース [億円]
2月26日時点 6,551,800

所要	[億円]
今積期の所要準備額	3,681,900
2月28日以降の残り所要	
積数	4,200
平均	300

国庫短期証券入札予定

2月28日	3ヶ月(第1290回)
3月6日	6ヶ月(第1291回)
3月7日	3ヶ月
3月14日	3ヶ月

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	1500	1,500	3	2月3日	0
1年超3年以下	3000	3,000	3 7 13 19	2月19日	0
3年超5年以下	3000	3,000	3 7 13 19 26	2月26日	0
5年超10年以下	3250	3,250	7 13 19 26	2月26日	0
10年超25年以下	1500	1,500	3 13 26	2月26日	0
25年超	750	750	13 19	2月19日	0
物価連動債	500	500	26	2月26日	0
変動利付債	-	300	-	2023/4/14	-

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