

短期市場の推移

[億円] [%]

	1月24日	1月27日	1月28日	1月29日
加重平均金利	▲0.016	▲0.019	▲0.020	▲0.025
東京レポレート(ON)	▲0.079	▲0.071	▲0.083	▲0.101
無コール残	83,595	78,501	84,423	83,852
ON	55,435	50,601	55,823	55,857
その他	28,160	27,900	28,600	27,995
有コール残	19,498	19,440	19,208	17,104

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。

1月31日の予定(時刻は日本時間)

日本			海外		
		予想			予想
8:30	12月有効求人倍率	1.57倍	19:00	(欧)10-12月期 域内総生産(GDP) 速報値[前年比]	1.1%
8:30	12月失業率	+2.3%	19:00	(欧)1月消費者物価 コア指数[前年比]	1.2%
	-		22:30	(米)12月個人消費支出	0.3%

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	▲0.060	0.001	▲0.032	▲0.132
T/N	-	-	-	▲0.125
S/N	-	-	▲0.005	-
1W	-	-	▲0.035	▲0.108
2W	▲0.015	▲0.010	▲0.012	▲0.103
3W	-	-	-	▲0.099
1M	-	-	0.020	▲0.099
2M	-	-	-	-
3M	-	-	0.010	▲0.106
6M	-	-	-	▲0.136
1Y	-	-	-	▲0.158

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▲0.02%の出合から始まった。
その後は主に▲0.035%~▲0.015%の水準で取引された。
昨日同様ビットサイドが慎重な姿勢となり、同加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.007%の▲0.032%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.050 ~ ▲0.050	▲0.025 ~ ▲0.025	▲0.035 ~ ▲0.015

翌営業日のマーケット

月末要因で調達を控える先もあると想定されるため、出会いの水準は低下すると予想。

資金需給

[億円]

	日銀速報	日銀予想	当社需給予想
	1月30日	1月31日	2月3日
券	+200	+400	+1,000
財政	+5,400	▲1,600	▲27,000
過不足	+5,600	▲1,200	▲26,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国庫短期証券買入			
国債買入		+12,000	
共通担保(全店)			
CP等買入	▲200	▲1,000	+2,500
社債等買入		▲100	
ETF買入			
国債補充供給	+200	▲300	+300
当座預金増減	+17,400	+500	▲26,000
当座預金残高	4,034,300	4,034,800	4,008,800
準備預金残高	3,501,200		
積み終了先	3,500,500		
超過準備	3,500,500		
非準備先残高	533,100		
準備預金進捗率	99.8%		
平均	48.0%		
乖離率	51.0%		

1月30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
国債補充供給(1/30~1/31)	330	330	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マネタリーベース [億円]
1月29日時点 5,151,100

所要	[億円]
今積期の所要準備額	3,239,900
1月31日以降の残り所要	
積数	7,300
平均	500

国庫短期証券入札予定

1月31日	3ヶ月	第885回
2月6日	6ヶ月	第886回
2月7日	3ヶ月	
2月14日	3ヶ月	
国債入札予定		
2月4日	10年	
2月6日	30年	
2月12日	物価運動	
2月18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	1月29日	0
1年超3年以下	3,000~5,000 程度	4,200		1月29日	0
3年超5年以下	2,000~4,500 程度	3,400	6 10 20 29	1月29日	0
5年超10年以下	2,000~5,000 程度	3,500	10 16 23 29	1月29日	0
10年超25年以下	500~1,500 程度	1,000		1月23日	0
25年超	0~500 程度	300	6 14 23		
物価運動債	300 程度	300	月2回程度	1月23日	0
変動利付債<偶数月>	1,000 程度	1,000	-	12月9日	-

1年前の市場推移 ○2019年1月積み期 [1月16日~2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。