

DAILY SIGNAL 上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

2020年1月31日(金)

短期市場の推移

[億円][%]

	1月27日	1月28日	1月29日	1月30日
加重平均金利	▲0.019	▲0.020	▲0.025	▲0.032
東京レポレート(ON)	▲0.071	▲0.083	▲0.101	▲0.132
無コール残	78,501	84,423	83,852	91,503
ON	50,601	55,823	55,857	62,788
その他	27,900	28,600	27,995	28,715
有コール残	19,440	19,208	17,104	17,356

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3日の予定 (時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
13:00	日銀当座預金増減要因と金融調節(1月実績)	-	1月の製造業PMI(確報)	
			アトランタ連銀総裁、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	▲0.080	0.001	▲0.039	▲0.093
T/N	-	-	-	▲0.082
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	0.002	▲0.085
2W	-	-	▲0.010	▲0.085
3W	-	-	-	▲0.089
1M	-	-	-	▲0.092
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.105
6M	-	-	-	▲0.135
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▲0.03%の出合から始まった。その後は主に▲0.065%~▲0.015%の水準で取引された。月末ということもあり、一部で調達を控える先も見られ、同加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.007%の▲0.039%となった。

都銀・信託		証券	地銀
▲0.065 ~ ▲0.065		▲0.045 ~ ▲0.040	▲0.065 ~ ▲0.015

翌営業日のマーケット

調達を控えていた先が戻ってくる見込みであるものの、慎重な動き出しとなる事が予想される。

資金需給

[億円]

	日銀速報	日銀予想	当社需給予想
	1月31日	2月3日	2月4日
券	+500	+900	+1,000
財政	▲3,400	▲31,100	▲72,000
過不足	▲2,900	▲30,200	▲71,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
CP等買入	▲1,000	+2,500	
社債等買入	▲100		
国債補完供給	+300	▲200	+200
当座預金増減	▲1,400	▲30,000	▲71,000
当座預金残高	4,032,900	4,002,900	3,931,900
準備預金残高	3,510,400	主な需給要因	
積み終了先	3,510,000	税保険揚げ	
超過準備	3,510,000	国債発行(2年)	
非準備先残高	522,500	国庫短期証券	
準備預金進捗率	99.8%	発行・償還(3M)	
平均	58.1%		
乖離率	41.7%		

1月31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
国債補完供給(1/31~2/3)	169	169	▲0.350	▲0.350		
	15	15	▲0.350	▲0.350		

国庫短期証券入札予定

2月6日	6ヶ月	第886回
2月7日	3ヶ月	第887回
2月14日	3ヶ月	
2月19日	1年	
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	

来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	2
1年超3年以下	3,000~5,500 程度	4,200	7 13 21 27	1月29日	4
3年超5年以下	2,000~4,500 程度	3,400	7 13 21 27	1月29日	4
5年超10年以下	2,000~5,000 程度	3,500	7 13 21 27	1月29日	4
10年超25年以下	500~2,000 程度	1,000	10 25	1月23日	2
25年超	0~500 程度	300	月2回程度	1月23日	2
物価運動債	300 程度	300	月1回	12月9日	1
変動利付債<偶数月>	1,000 程度	1,000			

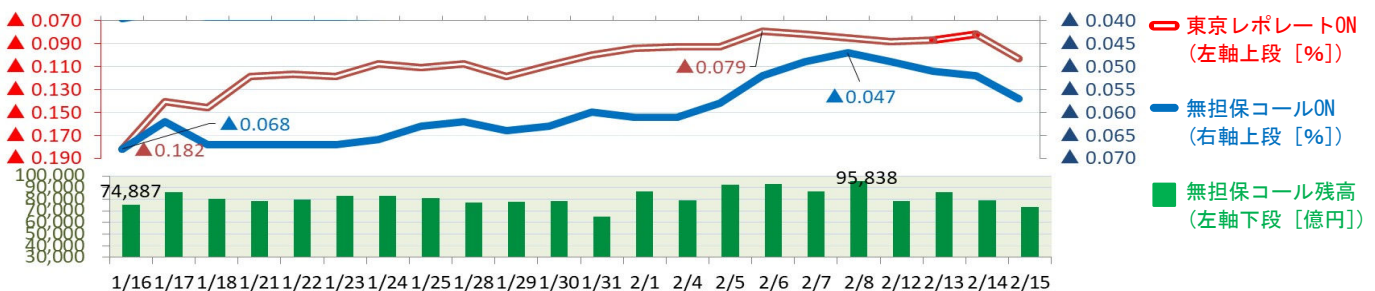
マナタリーベース [億円]
1月30日時点 5,174,000

所要 [億円]
今積期の所要準備額 3,236,300
2月3日以降の残り所要積数 6,100
平均 500

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。