

# DAILY SIGNAL 上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

2020年2月4日(火)

## 短期市場の推移

	1月29日	1月30日	1月31日	2月3日
加重平均金利	▲0.025	▲0.032	▲0.039	▲0.033
東京レポレート(ON)	▲0.101	▲0.132	▲0.093	▲0.064
無コール残	83,852	91,503	87,794	91,668
ON	55,857	62,788	61,309	63,143
その他	27,995	28,715	26,485	28,525
有コール残	17,104	17,356	17,883	20,033

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5日の予定 (時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
8:50	日銀当座預金増減要因 (2月見込み)	-	21:00	(米)MBA住宅ローン申請指数[前週比]
10:30	【挨拶】若田部副総裁 (愛媛)	-	22:15	(米)1月ADP全米雇用報告
			22:30	(米)12月貿易収支

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	▲0.023	▲0.073
T/N	-	-	-	▲0.083
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.010	0.002	▲0.003	▲0.072
2W	▲0.005	0.001	▲0.004	▲0.074
3W	-	-	0.001	▲0.079
1M	-	-	0.000	▲0.088
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.104
6M	-	-	0.000	▲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▲0.02%の出合から始まった。その後は主に▲0.045%~▲0.01%の水準で取引された。同加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.010%の▲0.023%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.045 ~ 0.001	▲0.025 ~ ▲0.010	▲0.065 ~ ▲0.010

## 翌営業日のマーケット

引き続き調達意欲は底堅く、出合の水準は概ね横ばいと予想する。

## 資金需給

	日銀速報 2月4日	日銀予想 2月5日	当社需給予想 2月6日
券	+900	+700	+0
財政	▲81,700	▲21,700	+3,000
過不足	▲80,800	▲21,000	+3,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国庫短期証券買入			+7,500
CP等買入		▲100	
ETF買入	+500		
国債補完供給	+100	▲400	+400
当座預金増減	▲80,600	▲13,200	+3,000
当座預金残高	3,924,800	3,911,600	3,914,600
準備預金残高	3,413,200	主な需給要因	
積み終了先	3,412,900	国債発行(10年)	
超過準備	3,412,200		
非準備先残高	511,600		
準備預金進捗率	99.9%		
平均	64.5%		
乖離率	35.4%		

## 2月4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
国庫短期証券買入(2/5~)	7,500	18,024	7,502	0.000	0.006	3.5
米ドル資金供給(2/6~2/14)			7	2.090	2.090	
国債補完供給(2/4~2/5)		392	392	▲0.350	▲0.350	
米ドル資金供給用担保国債供給(2/5~2/17)	5,000	6	6	▲0.100	▲0.100	

マナタリーベース [億円]  
2月3日時点 5,143,800

所要	所要準備額
今積期の所要準備額	3,236,300
2月5日以降の残り所要積数	3,300
平均	300

## 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6日	30年	
2月12日	物価運動	
2月18日	5年	
2月20日	20年	

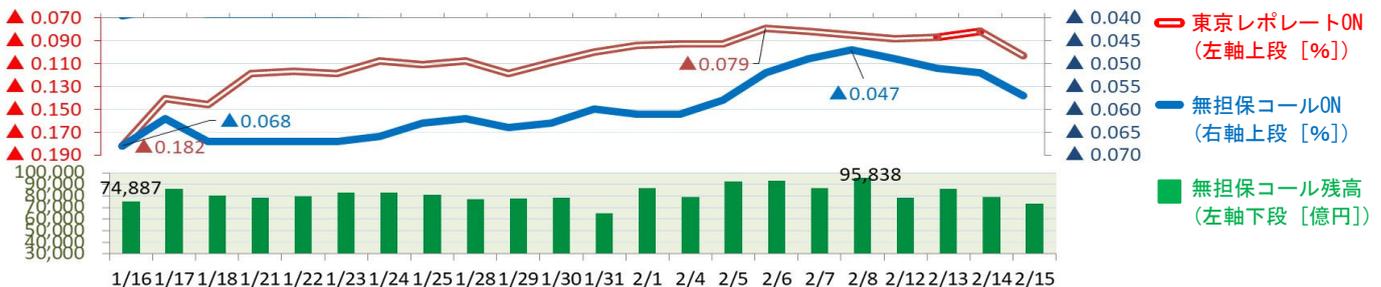
## 今月の国債買入オペ予定

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

## 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。